
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
2021 年年度报告
2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
§2 基金简介	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
3.3 过去三年基金的利润分配情况	6
§4 管理人报告	6
§5 托管人报告	13
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	226
8.1 期末基金资产组合情况	226
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	227
8.3 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	227
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	236
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	237
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	237
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	237
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	237
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	237
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	237
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	238
8.12 投资组合报告附注	238
§9 基金份额持有人信息	239
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	239
9.2 期末上市基金前十名持有人	240
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	240
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	240
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	240
§10 开放式基金份额变动	241
§11 重大事件揭示	241
§12 影响投资者决策的其他重要信息	245
§13 备查文件目录	246

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深 300ETF
场内简称	华夏 300（扩位证券简称：300ETF 基金）
基金主代码	510330
交易代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 25 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,759,349,828 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	2013 年 1 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		杨明辉	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	4,027,975,636.95	6,450,197,326.68	2,167,591,504.13
本期利润	-769,948,591.22	7,661,526,702.05	8,417,865,984.89
加权平均基金份额本期利润	-0.1462	1.1538	1.2106
本期加权平均净值利润率	-2.84%	26.38%	32.05%
本期基金份额净值增长率	-3.77%	29.45%	38.21%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	14,838,516,859.82	16,504,667,979.85	12,887,685,672.49
期末可供分配基金份额利润	2.5764	2.8630	1.7250
期末基金资产净值	28,908,846,530.65	30,588,190,074.58	31,140,013,496.13
期末基金份额净值	5.0195	5.3061	4.1680
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	142.02%	151.50%	94.28%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	1.48%	0.79%	1.52%	0.79%	-0.04%	0.00%
过去六个月	-4.64%	1.02%	-5.43%	1.02%	0.79%	0.00%
过去一年	-3.77%	1.17%	-5.20%	1.17%	1.43%	0.00%
过去三年	72.17%	1.29%	64.10%	1.29%	8.07%	0.00%
过去五年	62.11%	1.20%	49.25%	1.20%	12.86%	0.00%
自基金合同生效起至今	142.02%	1.44%	107.47%	1.44%	34.55%	0.00%

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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

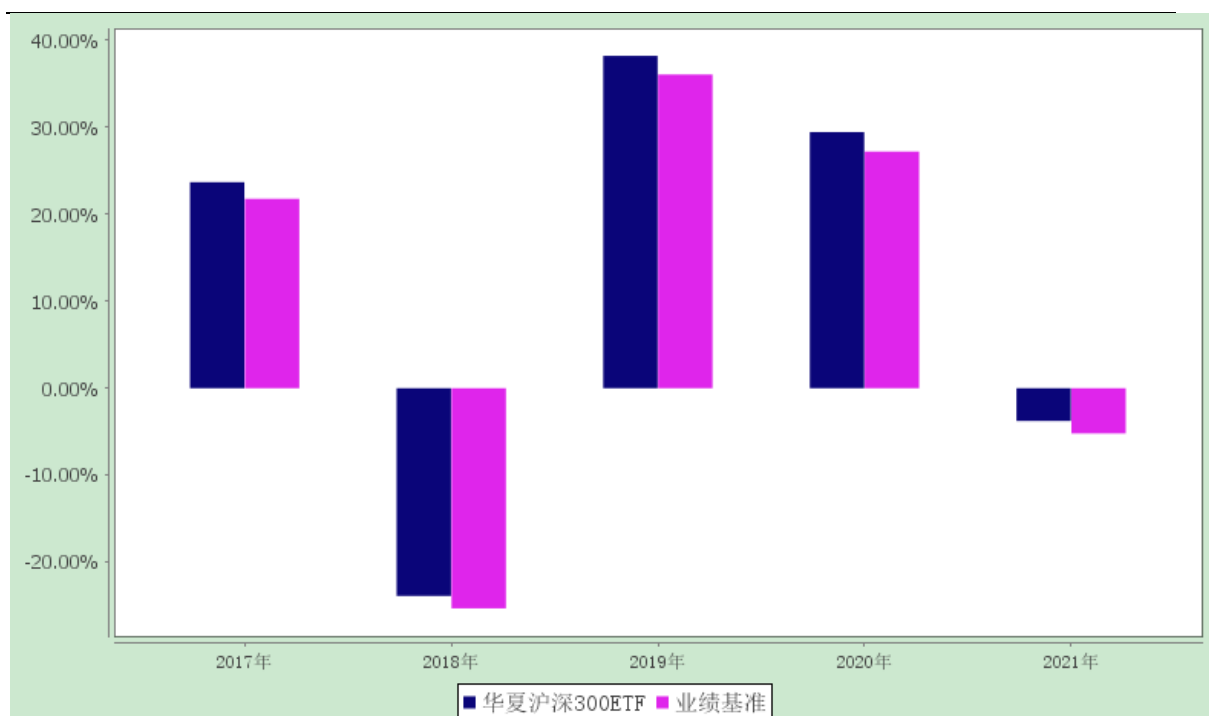
(2012 年 12 月 25 日至 2021 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	0.960	533,975,983.52	-	533,975,983.52	-
2020 年	0.710	538,886,437.85	-	538,886,437.85	-
合计	1.670	1,072,862,421.37	-	1,072,862,421.37	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，首批公募 MOM 基金管理人、以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香

港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

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

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2021 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 QDII 混合基金（A 类）中华夏全球聚享（QDII）（A 类）排序第 1/35；在偏股型基金（股票上限 95%）（A 类）中华夏兴和混合排序第 1/176、华夏兴华混合（A 类）排序第 32/176；在定期开放式偏股型基金（A 类）中华夏磐利一年定开混合（A 类）排序第 1/63、华夏成长精选 6 个月定开混合（A 类）排序第 17/63；在偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）中华夏行业景气混合排序第 2/692、华夏盛世混合排序第 14/692；在其他行业股票型基金（A 类）中华夏能源革新股票（A 类）排序第 6/33；在偏股型基金（股票上限 80%）（A 类）中华夏经典混合排序第 10/132；在标准股票型基金（A 类）中华夏智胜价值成长股票（A 类）排序第 41/259；在灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+ 基准股票比例 30%-60%）（A 类）中华夏高端制造混合排序第 79/499。

指数与量化策略产品：在信用债指数债券型基金（A 类）中华夏亚债中国指数（A 类）排序第 2/18；在策略指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏创成长 ETF 联接（A 类）排序第 3/14；在增强规模指数股票型基金（A 类）中华夏中证 500 指数增强（A 类）排序第 4/103；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 4/95、华夏中证四川国改 ETF 排序第 7/95、华夏国证半导体芯片 ETF 排序第 10/95；在策略指数股票 ETF 基金中华夏创成长 ETF 排序第 5/23；在主题指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证四川国改 ETF 联接（A 类）排序第 5/55、华夏国证半导体芯片 ETF 联接（A 类）排序第 7/55；在定期开放式绝对收益目标基金（A 类）中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排序第 5/24；在行业指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证全指房地产 ETF 联接（A 类）排序第 7/27、华夏中证银行 ETF 联接（A 类）排序第 8/27；在利率债指数债券型基金（A 类）中华夏中债 3-5 年政金债指数（A 类）排序第 8/103；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 10/42；在规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）中华夏中证 500ETF 联接（A 类）排序第 13/75；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 500ETF 排序第 16/113、华夏创业板 ETF 排序第 22/113。

固收&“固收+”产品：在 QDII 债券型基金（A 类）中华夏大中华信用债券（QDII）（A 类）排序第 1/25、华夏收益债券（QDII）（A 类）排序第 4/25；在偏债型基金（A 类）中华夏永康添福混合排序第 4/231、华夏磐泰混合（LOF）（A 类）排序第 20/231、华夏睿磐泰茂混合（A 类）排序第 26/231、华夏睿

磐泰利混合(A类)排序第 29/231、华夏睿磐泰兴混合排序第 34/231；在长期纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎航债券(A类)排序第 29/615、华夏鼎茂债券(A类)排序第 85/615；在短期纯债债券型基金（A 类）中华夏短债债券(A类)排序第 8/54；在普通债券型基金(可投转债)(A类)中华夏聚利债券排序第 14/203、华夏双债债券(A类)排序第 32/203；在普通债券型基金（二级）（A 类）中华夏鼎泓债券(A类)排序第 31/258；在定期开放式纯债债券型基金（A 类）中华夏鼎瑞三个月定期开放债券(A类)排序第 80/427。

养老&FOF 产品：在混合型 FOF（权益资产 0-30%）（A 类）中华夏聚丰混合（FOF）（A 类）排序第 1/16、华夏聚惠 FOF(A类)排序第 3/16；在养老目标日期 FOF（2040）（A 类）中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/11。

在客户服务方面，2021 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销上线邮储银行卡直连、交通银行卡快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端上线人脸识别，盖章账单自动生成，非货基收益提醒及预约赎回等功能，提升了投资者业务办理的方便快捷性，在震荡的市场行情下方便投资者及时掌握基金收益情况，增加客户操作便利性；（3）与民商基金销售、众惠基金、泰信财富、排排网基金销售等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“震荡市需要口服镇心丸”、“发个暗号，看多少人在嗑这对 CP？”、“牙掉了之后”、“准备好了吗？来跟我们一起碳中和！”、“华夏亲子财商营”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
赵宗庭	本基金的基金经理	2017-04-17	-	13 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。
张弘弢	本基金的基金经理、投委会成员	2012-12-25	-	21 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司。曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8

					月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理 (2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理 (2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间)、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间)等。
--	--	--	--	--	---

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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
张弘弢	公募基金	9	139,429,961,194.45	2009-07-10
	私募资产管理计划	2	43,657,877.66	2021-07-16
	其他组合	-	-	-
	合计	11	139,473,619,072.11	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则,对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求,未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易,交易时机和交易价差均可合理解释,未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》要求,针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析,本年度各组合间收益率差异均属正常情况,主要原因为业绩基准不同、投资策略不同,收益率差异可以合理解释。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 73 次,其中 52 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易,其余 21 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数,沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成,自 2005 年 4 月 8 日起正式发布,以综合反映沪深 A 股市场整体表现。

沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2021 年，新冠疫情的反复使得全球经济复苏动能减弱，劳动力市场恢复缓慢，供给瓶颈凸显，形成全球经济复苏边际放缓与供应链摩擦加剧相叠加的局面，通胀预期升温，金融市场波动加大；为提前应对通货膨胀、汇率贬值、资本外流等压力，土耳其、巴西等部分新兴经济体从 1 季度就开始加息，美国等主要发达经济体则在 4 季度开始边际收紧货币政策以应对通胀持续走高。国内方面，我国在统筹经济发展和疫情防控方面取得的成效全球瞩目，经济社会发展总体稳定，在疫情冲击和宏观政策偏紧的背景下，经济走势前高后低，由于低基数逐渐消退、政策回归常态化，GDP 增速逐季下行；跨周期调节发力，稳增长政策加码，高质量发展取得新成效，实现了“十四五”良好开局。

市场方面，A 股市场 2021 年整体表现不错，万得全 A 指数上涨 9.17%，市场风格完全切换，小盘股整体表现优于大盘股，沪深 300 指数下跌 5.20%，中证 500 指数上涨 15.58%，中证 1000 指数上涨 20.52%。行业板块表现分化较大，新能源板块以及基础化工、有色金属、煤炭、钢铁等顺周期板块全年表现较好，大消费、金融地产、医药等板块表现落后。

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

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商为中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、招商证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 5.0195 元，本报告期份额净值增长率为-3.77%，同期业绩比较基准增长率-5.20%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.43%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，随着疫苗接种加快与特效药面市，全球新冠疫情将可能逐步消退。国际方面，从

基本面看，全球经济增速将放缓，IMF 预计 2021 年全球经济增速为 5.9%，2022 年下降至 4.4%，通胀预计将维持高位，2022 年发达经济体的平均通胀率预计为 3.9%，新兴市场和发展中经济体为 5.9%；从政策面看，全球的货币环境已经收紧，随着价格和工资压力扩大，美联储决定加快缩减资产购买，并表示将在 2022 年进一步加息，超过先前预期，欧洲央行已宣布将于 2022 年 3 月停止在“紧急抗疫购债计划”下净购入资产，暂不会退出宽松政策，但仍难以加码。国内方面，从基本面看，房地产目前正在收缩，私人消费恢复慢于预期，影响中国经济增长前景，IMF 预测中国 2022 年和 2023 年 GDP 增速分别为 4.8%和 5.2%，较 2021 年 8.1%的增速有明显放缓，企业盈利增速也将有所下行，但在跨周期调节下，下行幅度可控；从政策面看，政策基调边际转松，稳增长意愿提升，货币政策偏松调节，但难以“大水漫灌”，市场流动性仍将维持合理充裕，剩余流动性 2022 年将保持温和大于零的状态。

市场方面，预计全年 A 股总体呈现震荡走势，但仍有结构性机会，成长股被热捧或有降温，价值股或有均值回复行情；以食品饮料、家用电器为代表的消费、医药以及金融等 2021 年表现较弱的板块有望取得相对更好的表现。此外，从历史来看，在政府换届的年份，A 股市场整体表现通常不会差。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司着力加强合规制度建设，在投资、销售、员工行为合规管理等方面出台多项管理制度。同时，继续强化业务部门专兼合规管理职责，规范任免流程，提高工作质量，完善合规管理组织机制。公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。公司开展多种形式的法律法规和廉洁从业培训，提升员工的合规意识，促进廉洁从业。公司严格落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完

整。

86 审计报告

普华永道中天审字（2022）第 24782 号

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

（一）我们审计的内容

我们审计了华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏沪深 300ETF”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

（二）我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏沪深 300ETF 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏沪深 300ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏沪深 300ETF 的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华夏沪深 300ETF 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华夏沪深 300ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏沪深 300ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏沪深 300ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏沪深 300ETF 不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

单峰 朱宏宇

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2022 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	27,638,718.23	59,012,304.81
结算备付金		188,358,586.41	201,880,755.76
存出保证金		27,128,180.22	34,389,295.83
交易性金融资产	7.4.7.2	28,697,060,869.42	30,304,267,423.12
其中：股票投资		28,697,060,869.42	30,302,438,423.12
基金投资		-	-
债券投资		-	1,829,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		111,273,067.79	41,841,462.50
应收利息	7.4.7.5	1,563,446.91	3,120,937.71
应收股利		2,024.70	13,597.55
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		29,053,024,893.68	30,644,525,777.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		105,353,159.01	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,676,773.42	12,461,987.21
应付托管费		2,335,354.69	2,492,397.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,879,002.64	2,187,728.68
应交税费		141,194.31	581,605.08

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	21,792,878.96	38,611,984.30
负债合计		144,178,363.03	56,335,702.70
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	14,070,329,670.83	14,083,522,094.73
未分配利润	7.4.7.10	14,838,516,859.82	16,504,667,979.85
所有者权益合计		28,908,846,530.65	30,588,190,074.58
负债和所有者权益总计		29,053,024,893.68	30,644,525,777.28

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.0195 元，基金份额总额 5,759,349,828.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-573,799,309.40	7,872,328,721.74
1.利息收入		53,626,400.98	28,938,712.30
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,476,864.16	3,770,579.32
债券利息收入		8,392.98	9,734.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		43,134.24	21,580.54
证券出借利息收入		49,098,009.60	25,136,818.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,149,766,481.18	6,615,858,419.07
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,653,873,604.18	5,932,488,530.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	12,102,219.73	18,597,512.58
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	12,762,171.84	67,410,966.99
股利收益	7.4.7.16	471,028,485.43	597,361,408.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-4,797,924,228.17	1,211,329,375.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	20,732,036.61	16,202,215.00
减：二、费用		196,149,281.82	210,802,019.69

1. 管理人报酬		135,444,428.50	144,912,140.25
2. 托管费		27,088,885.67	28,982,428.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	25,032,923.34	27,680,898.69
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		202,448.83	277,640.64
7. 其他费用	7.4.7.20	8,380,595.48	8,948,912.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-769,948,591.22	7,661,526,702.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-769,948,591.22	7,661,526,702.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,083,522,094.73	16,504,667,979.85	30,588,190,074.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-769,948,591.22	-769,948,591.22
三、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）	-13,192,423.90	-362,226,545.29	-375,418,969.19
其中：1.基金申购款	13,821,262,027.71	15,323,357,502.16	29,144,619,529.87
2.基金赎回款	-13,834,454,451.61	-15,685,584,047.45	-29,520,038,499.06
四、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）	-	-533,975,983.52	-533,975,983.52
五、期末所有者权益（基金净值）	14,070,329,670.83	14,838,516,859.82	28,908,846,530.65
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	18,252,327,823.64	12,887,685,672.49	31,140,013,496.13

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,661,526,702.05	7,661,526,702.05
三、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）	-4,168,805,728.91	-3,505,657,956.84	-7,674,463,685.75
其中：1.基金申购款	17,730,616,765.62	14,388,953,011.35	32,119,569,776.97
2.基金赎回款	-21,899,422,494.53	-17,894,610,968.19	-39,794,033,462.72
四、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）	-	-538,886,437.85	-538,886,437.85
五、期末所有者权益（基金净值）	14,083,522,094.73	16,504,667,979.85	30,588,190,074.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉 主管会计工作负责人：朱威 会计机构负责人：朱威

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1653 号《关于核准华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》的核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2012 年 12 月 17 日至 2012 年 12 月 19 日期间共募集 602,764,295.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（12）第 0075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 602,808,845 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,550 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他

金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

根据《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2013 年 1 月 9 日为基金份额折算日。折算后的基金份额净值与 2013 年 1 月 9 日沪深 300 指数收盘值的千分之一基本一致。折算前基金份额总额为 16,020,609,566 份，本次基金份额折算比例为 0.40932601，折算后基金份额总额为 6,557,649,828 份。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产

列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资

资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现收益孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗

交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通

机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	27,638,718.23	59,012,304.81
定期存款	-	-
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	-	-
合计	27,638,718.23	59,012,304.81

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		27,892,274,512.42	28,697,060,869.42	804,786,357.00
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		27,892,274,512.42	28,697,060,869.42	804,786,357.00
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		24,716,662,657.95	30,302,438,423.12	5,585,775,765.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,829,000.00	1,829,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,829,000.00	1,829,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		24,718,491,657.95	30,304,267,423.12	5,585,775,765.17

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	218,100,300.00	-	-	-
其中：股指期货	218,100,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	218,100,300.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	251,605,980.00	-	-	-
其中：股指期货	251,605,980.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	251,605,980.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资明细详见“报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细”相关表格。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,773.68	6,638.08

应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	112,840.27	113,507.01
应收债券利息	-	32.07
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	1,445,196.28	2,999,525.91
其他	636.68	1,234.64
合计	1,563,446.91	3,120,937.71

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,879,002.64	2,187,728.68
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,879,002.64	2,187,728.68

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	250,000.00	250,000.00
应付指数使用费	1,946,769.61	2,178,815.59
应退替代款	18,864,093.32	36,028,213.99
可退替代款	732,016.03	154,954.72
合计	21,792,878.96	38,611,984.30

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
----	--

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,764,749,828.00	14,083,522,094.73
本期申购	5,657,400,000.00	13,821,262,027.71
本期赎回（以“-”号填列）	-5,662,800,000.00	-13,834,454,451.61
本期末	5,759,349,828.00	14,070,329,670.83

7.4.7.10 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	20,040,385,533.81	-3,535,717,553.96	16,504,667,979.85
本期利润	4,027,975,636.95	-4,797,924,228.17	-769,948,591.22
本期基金份额交易产生的变动数	248,351,861.64	-610,578,406.93	-362,226,545.29
其中：基金申购款	22,141,762,262.77	-6,818,404,760.61	15,323,357,502.16
基金赎回款	-21,893,410,401.13	6,207,826,353.68	-15,685,584,047.45
本期已分配利润	-533,975,983.52	-	-533,975,983.52
本期末	23,782,737,048.88	-8,944,220,189.06	14,838,516,859.82

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	228,022.32	459,360.12
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	4,217,488.22	3,282,639.89
其他	31,353.62	28,579.31
合计	4,476,864.16	3,770,579.32

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,971,497,658.08	3,572,839,669.63
股票投资收益——赎回差价收入	1,682,375,946.10	2,359,648,861.15
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	3,653,873,604.18	5,932,488,530.78

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	18,544,715,294.40	20,494,237,467.37
减：卖出股票成本总额	16,573,217,636.32	16,921,397,797.74
买卖股票差价收入	1,971,497,658.08	3,572,839,669.63

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	29,520,038,499.06	39,794,033,462.72
减：现金支付赎回款总额	11,698,776,122.06	15,155,451,989.72
减：赎回股票成本总额	16,138,886,430.90	22,278,932,611.85
赎回差价收入	1,682,375,946.10	2,359,648,861.15

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	82,749,858.89	82,511,747.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	70,639,100.00	63,904,200.00
减：应收利息总额	8,539.16	10,034.68
买卖债券差价收入	12,102,219.73	18,597,512.58

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	12,762,171.84	67,410,966.99
合计	12,762,171.84	67,410,966.99

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	471,028,485.43	597,361,408.72
其中：证券出借权益补偿收入	39,439,647.46	22,008,625.49
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	471,028,485.43	597,361,408.72

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-4,780,989,408.17	1,202,370,331.37
——股票投资	-4,780,989,408.17	1,202,370,331.37
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-16,934,820.00	8,959,044.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-16,934,820.00	8,959,044.00
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	-4,797,924,228.17	1,211,329,375.37

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	15,148,744.03	16,201,743.23
其他	5,583,292.58	471.77
合计	20,732,036.61	16,202,215.00

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	25,032,923.34	27,680,898.69
银行间市场交易费用	-	-
合计	25,032,923.34	27,680,898.69

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	130,000.00	130,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	3,929.84	4,183.77
指数使用费	8,126,665.64	8,694,728.34
合计	8,380,595.48	8,948,912.11

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金管理人于 2022 年 1 月 11 日发布的分红公告，本基金向 2022 年 1 月 14 日在本基金登记结算机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.790 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 （“华夏沪深 300ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人股东控股的公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	7,190,392,442.09	19.41%	7,444,876,014.04	19.50%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	44,309,112.00	53.55%	14,352,037.35	17.39%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

中信证券	20,000,000.00	28.57%	-	-
------	---------------	--------	---	---

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	584,731.07	19.41%	221,893.43	7.71%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	618,062.83	17.40%	256,764.62	11.74%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	135,444,428.50	144,912,140.25
其中：支付销售机构的客户维护费	216,027.66	246,440.79

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

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

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	27,088,885.67	28,982,428.00

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	13,321,217,336.28	14,472,782.36	1,543,410,285.12	742,840.46
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	4,415,596,066.01	4,834,887.14	821,905,235.24	279,286.90

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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限 (单位：天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	2021010400013626	东方财富	2021-01-04	2,630,740.00	81,700.00	28	3.30	6,752.23	-	-
中信证券	202101040001	沃森生物	2021-01-04	1,608,600.00	42,000.00	28	3.50	4,378.97	-	-

	3636									
中信 证券	2021 0104 0001 3638	宋城演 艺	2021- 01-04	377,9 70.00	21,500.00	28	3.3 0	970.1 2	-	-
中信 证券	2021 0105 0001 0242	蓝思科 技	2021- 01-05	2,068 ,200. 00	60,000.00	14	4.2 0	3,378 .06	-	-
中信 证券	2021 0105 0001 0250	蓝思科 技	2021- 01-05	517,0 50.00	15,000.00	14	4.2 0	844.5 2	-	-
中信 证券	2021 0107 0001 2502	蓝思科 技	2021- 01-07	351,8 00.00	10,000.00	28	4.1 0	1,121 .85	-	-
中信 证券	2021 0107 0001 2514	亿纬锂 能	2021- 01-07	1,585 ,600. 00	16,000.00	14	3.5 0	2,158 .18	-	-
中信 证券	2021 0112 0000 0339	泰格医 药	2021- 01-12	2,779 ,500. 00	17,000.00	28	3.4 0	7,350 .23	-	-
中信 证券	2021 0114 0000 9381	温氏股 份	2021- 01-14	8,523 ,800. 00	460,000.0 0	28	3.3 0	27,34 7.19	-	-
中信 证券	2021 0114 0000 9383	东方财 富	2021- 01-14	5,478 ,000. 00	150,000.0 0	28	3.4 0	18,10 7.84	-	-
中信 证券	2021 0119 0000 0360	温氏股 份	2021- 01-19	201,1 90.00	11,000.00	14	3.3 0	258.1 9	-	-
中信 证券	2021 0119 0000 7462	蓝思科 技	2021- 01-19	581,1 00.00	15,000.00	14	3.8 0	858.7 4	-	-
中信 证券	2021 0119 0000 7464	蓝思科 技	2021- 01-19	2,324 ,400. 00	60,000.00	14	3.8 0	3,434 .95	-	-

中信 证券	2021 0121 0001 3263	亿纬锂 能	2021- 01-21	1,689 ,760. 00	16,000.00	14	3.5 0	2,299 .95	-	-
中信 证券	2021 0126 0000 6598	亿联网 络	2021- 01-26	1,320 ,624. 00	16,200.00	28	3.4 0	3,492 .32	-	-
中信 证券	2021 0126 0000 6600	东方财 富	2021- 01-26	7,829 ,356. 00	213,800.0 0	28	3.5 0	21,31 3.25	-	-
中信 证券	2021 0201 0000 9072	东方财 富	2021- 02-01	2,931 ,396. 00	81,700.00	28	3.3 0	7,523 .92	-	-
中信 证券	2021 0201 0000 9090	宋城演 艺	2021- 02-01	367,0 05.00	21,500.00	28	3.4 0	970.5 2	-	-
中信 证券	2021 0202 0000 8849	蓝思科 技	2021- 02-02	1,944 ,000. 00	60,000.00	14	3.8 0	3,283 .20	-	-
中信 证券	2021 0204 0000 0436	乐普医 疗	2021- 02-04	338,0 10.00	11,400.00	28	3.5 0	920.1 4	-	-
中信 证券	2021 0204 0001 3621	蓝思科 技	2021- 02-04	306,6 00.00	10,000.00	28	3.7 0	882.3 3	-	-
中信 证券	2021 0209 0000 0489	乐普医 疗	2021- 02-09	322,3 00.00	10,000.00	14	3.6 0	451.2 2	-	-
中信 证券	2021 0209 0000 0493	东方财 富	2021- 02-09	3,816 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.5 0	5,194 .00	-	-
中信 证券	2021 0209 0000 0497	传音控 股	2021- 02-09	2,452 ,000. 00	10,000.00	14	3.2 0	3,051 .38	-	-
中信	2021	东方财	2021-	5,643	150,000.0	28	3.3	14,48	-	-

证券	0218 0003 8544	富	02-18	,000. 00	0		0	3.70		
中信 证券	2021 0218 0003 8548	蓝思科 技	2021- 02-18	1,931 ,400. 00	60,000.00	14	4.6 0	3,455 .06	-	-
中信 证券	2021 0223 0000 6566	乐普医 疗	2021- 02-23	319,3 00.00	10,000.00	14	3.6 0	447.0 2	-	-
中信 证券	2021 0223 0000 6568	东方财 富	2021- 02-23	3,355 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.5 0	4,566 .53	-	-
中信 证券	2021 0223 0000 7000	传音控 股	2021- 02-23	2,008 ,300. 00	10,000.00	14	3.2 0	2,499 .22	-	-
中信 证券	2021 0223 0000 7206	亿联网 络	2021- 02-23	1,343 ,304. 00	16,200.00	28	3.2 0	3,343 .33	-	-
中信 证券	2021 0223 0000 7208	东方财 富	2021- 02-23	7,172 ,990. 00	213,800.0 0	28	3.3 0	18,41 0.67	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 0630	宋城演 艺	2021- 02-24	197,5 00.00	10,000.00	28	3.3 0	506.9 2	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6560	蓝思科 技	2021- 02-24	519,2 55.00	16,500.00	28	4.0 0	1,615 .46	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6562	信维通 信	2021- 02-24	341,8 00.00	10,000.00	28	3.5 0	930.4 6	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6564	爱尔眼 科	2021- 02-24	1,720 ,170. 00	23,000.00	28	3.4 0	4,548 .89	-	-
中信 证券	2021 0224	宋城演 艺	2021- 02-24	339,7 00.00	17,200.00	28	3.5 0	924.7 4	-	-

	0000 6566									
中信 证券	2021 0224 0000 6568	汇川技 术	2021- 02-24	1,087 ,185. 00	12,100.00	28	3.3 0	2,790 .44	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6570	三环集 团	2021- 02-24	642,4 92.00	16,200.00	28	3.4 0	1,699 .03	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6614	泰格医 药	2021- 02-24	1,529 ,000. 00	10,000.00	28	3.4 0	4,043 .36	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6616	亿纬锂 能	2021- 02-24	938,1 00.00	10,600.00	28	3.2 0	2,334 .83	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6618	温氏股 份	2021- 02-24	951,8 60.00	52,300.00	28	3.2 0	2,369 .07	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6620	智飞生 物	2021- 02-24	2,176 ,200. 00	13,500.00	28	3.5 0	5,924 .10	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6622	乐普医 疗	2021- 02-24	471,1 35.00	14,700.00	28	3.5 0	1,282 .53	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6624	沃森生 物	2021- 02-24	1,279 ,161. 00	26,100.00	28	4.0 0	3,979 .61	-	-
中信 证券	2021 0224 0000 6626	芒果超 媒	2021- 02-24	671,2 00.00	10,000.00	28	3.2 0	1,670 .54	-	-
中信 证券	2021 0304 0003 4637	乐普医 疗	2021- 03-04	355,3 38.00	11,400.00	28	3.4 0	939.6 7	-	-
中信 证券	2021 0304 0003	蓝思科 技	2021- 03-04	1,852 ,800. 00	60,000.00	14	3.6 0	2,593 .92	-	-

	4651									
中信 证券	2021 0304 0003 5033	蓝思科 技	2021- 03-04	308,8 00.00	10,000.00	28	3.5 0	840.6 2	-	-
中信 证券	2021 0309 0000 7663	传音控 股	2021- 03-09	1,761 ,100. 00	10,000.00	14	3.2 0	2,191 .59	-	-
中信 证券	2021 0309 0000 7667	乐普医 疗	2021- 03-09	285,0 00.00	10,000.00	14	3.6 0	399.0 0	-	-
中信 证券	2021 0309 0000 7687	东方财 富	2021- 03-09	2,753 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.4 0	3,640 .08	-	-
中信 证券	2021 0311 0000 0509	汇川技 术	2021- 03-11	1,047 ,600. 00	12,000.00	28	3.2 0	2,607 .36	-	-
中信 证券	2021 0311 0000 0529	汇川技 术	2021- 03-11	1,021 ,410. 00	11,700.00	14	3.3 0	1,310 .81	-	-
中信 证券	2021 0318 0003 8094	蓝思科 技	2021- 03-18	1,555 ,800. 00	60,000.00	14	3.5 0	2,117 .62	-	-
中信 证券	2021 0318 0003 8112	东方财 富	2021- 03-18	4,236 ,000. 00	150,000.0 0	28	3.4 0	11,20 1.87	-	-
中信 证券	2021 0323 0000 7721	传音控 股	2021- 03-23	2,021 ,000. 00	10,000.00	14	3.2 0	2,515 .02	-	-
中信 证券	2021 0323 0000 7735	东方财 富	2021- 03-23	2,715 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.4 0	3,589 .83	-	-
中信 证券	2021 0323 0000 7737	东方财 富	2021- 03-23	5,804 ,670. 00	213,800.0 0	28	3.3 0	14,89 8.65	-	-

中信 证券	2021 0323 0000 7745	亿联网络	2021- 03-23	1,072 ,440. 00	16,200.00	28	3.2 0	2,669 .18	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6284	宋城演艺	2021- 03-24	203,5 00.00	10,000.00	28	3.4 0	538.1 4	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6288	沃森生物	2021- 03-24	1,191 ,204. 00	26,100.00	28	3.4 0	3,150 .07	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6290	宋城演艺	2021- 03-24	350,0 20.00	17,200.00	28	3.4 0	925.6 1	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6292	泰格医药	2021- 03-24	1,292 ,700. 00	10,000.00	28	3.5 0	3,519 .02	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6294	乐普医疗	2021- 03-24	418,8 03.00	14,700.00	28	3.4 0	1,107 .50	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6296	亿纬锂能	2021- 03-24	739,4 56.00	10,600.00	28	3.4 0	1,955 .45	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6298	汇川技术	2021- 03-24	973,5 66.00	12,100.00	28	3.2 0	2,423 .10	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6300	爱尔眼科	2021- 03-24	1,373 ,560. 00	23,000.00	28	3.2 0	3,418 .64	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6302	信维通信	2021- 03-24	270,2 00.00	10,000.00	28	4.2 0	882.6 5	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6304	智飞生物	2021- 03-24	2,387 ,475. 00	13,500.00	28	3.4 0	6,313 .55	-	-
中信	2021	三环集	2021-	590,9	16,200.00	28	3.9	1,792	-	-

证券	0324 0000 6306	团	03-24	76.00			0	.63		
中信 证券	2021 0324 0000 6308	芒果超 媒	2021- 03-24	565,5 00.00	10,000.00	28	3.3 0	1,451 .45	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6312	蓝思科 技	2021- 03-24	400,9 50.00	16,500.00	28	3.4 0	1,060 .29	-	-
中信 证券	2021 0324 0000 6314	温氏股 份	2021- 03-24	895,8 99.00	52,300.00	28	3.2 0	2,229 .79	-	-
中信 证券	2021 0401 0000 0476	康泰生 物	2021- 04-01	1,380 ,200. 00	10,000.00	14	3.4 0	1,824 .93	-	-
中信 证券	2021 0406 0000 0654	沃森生 物	2021- 04-06	442,0 00.00	10,000.00	14	3.5 0	601.6 1	-	-
中信 证券	2021 0406 0000 0750	温氏股 份	2021- 04-06	167,3 00.00	10,000.00	14	3.4 0	221.2 1	-	-
中信 证券	2021 0406 0001 7104	东方财 富	2021- 04-06	2,861 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.3 0	3,671 .62	-	-
中信 证券	2021 0406 0001 7132	传音控 股	2021- 04-06	2,049 ,800. 00	10,000.00	14	3.2 0	2,550 .86	-	-
中信 证券	2021 0408 0000 0526	温氏股 份	2021- 04-08	164,4 00.00	10,000.00	14	3.4 0	217.3 7	-	-
中信 证券	2021 0419 0000 4123	乐普医 疗	2021- 03-24	1,799 .66	-	28	3.4 0	-	-	-
中信 证券	2021 0420	东方财 富	2021- 04-20	297,8 00.00	10,000.00	14	3.3 0	436.7 8	-	-

	0000 1151									
中信 证券	2021 0420 0000 1153	宋城演 艺	2021- 04-20	208,6 00.00	10,000.00	14	2.7 0	250.3 2	-	-
中信 证券	2021 0420 0000 1155	乐普医 疗	2021- 04-20	277,6 00.00	10,000.00	14	3.4 0	419.4 9	-	-
中信 证券	2021 0420 0001 5606	沃森生 物	2021- 04-20	522,6 00.00	10,000.00	14	3.5 0	812.9 4	-	-
中信 证券	2021 0420 0001 5610	东方财 富	2021- 04-20	2,978 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.0 0	3,970 .66	-	-
中信 证券	2021 0420 0001 5630	传音控 股	2021- 04-20	1,705 ,200. 00	10,000.00	14	2.3 0	1,743 .10	-	-
中信 证券	2021 0421 0000 7489	宋城演 艺	2021- 04-21	218,1 00.00	10,000.00	28	3.2 0	542.8 3	-	-
中信 证券	2021 0421 0000 8225	温氏股 份	2021- 03-24	2,504 .60	-	28	3.2 0	-	-	-
中信 证券	2021 0422 0000 0612	温氏股 份	2021- 04-22	151,6 00.00	10,000.00	14	3.4 0	200.4 5	-	-
中信 证券	2021 0422 0000 0624	爱尔眼 科	2021- 04-22	9,547 ,500. 00	150,000.0 0	28	3.3 0	24,50 5.25	-	-
中信 证券	2021 0427 0000 0839	乐普医 疗	2021- 04-27	315,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	392.0 0	-	-
中信 证券	2021 0429 0000	东方财 富	2021- 04-29	319,9 00.00	10,000.00	14	3.3 0	410.5 4	-	-

	0601									
中信 证券	2021 0429 0000 0605	乐普医 疗	2021- 04-29	320,3 00.00	10,000.00	14	3.2 0	398.6 0	-	-
中信 证券	2021 0429 0000 0621	温氏股 份	2021- 04-29	296,4 30.00	20,500.00	14	3.3 0	380.4 2	-	-
中信 证券	2021 0506 0000 0893	温氏股 份	2021- 05-06	141,7 00.00	10,000.00	14	3.3 0	181.8 5	-	-
中信 证券	2021 0506 0002 8236	东方财 富	2021- 05-06	3,130 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.3 0	4,016 .83	-	-
中信 证券	2021 0506 0002 8238	东方财 富	2021- 05-06	313,0 00.00	10,000.00	14	3.3 0	401.6 8	-	-
中信 证券	2021 0506 0002 8244	宋城演 艺	2021- 05-06	205,6 00.00	10,000.00	14	2.7 0	215.8 8	-	-
中信 证券	2021 0506 0002 8252	传音控 股	2021- 05-06	1,636 ,300. 00	10,000.00	14	2.5 0	1,590 .85	-	-
中信 证券	2021 0506 0002 8810	乐普医 疗	2021- 05-06	310,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	385.7 8	-	-
中信 证券	2021 0506 0002 8816	沃森生 物	2021- 05-06	557,5 00.00	10,000.00	14	3.6 0	780.5 0	-	-
中信 证券	2021 0506 0002 8818	温氏股 份	2021- 05-06	141,7 00.00	10,000.00	14	3.3 0	181.8 5	-	-
中信 证券	2021 0511 0000 0946	智飞生 物	2021- 05-11	2,098 ,200. 00	10,000.00	14	3.4 0	2,774 .29	-	-

中信 证券	2021 0511 0000 0948	温氏股 份	2021- 05-11	284,0 74.00	20,600.00	14	3.2 0	353.5 1	-	-
中信 证券	2021 0511 0000 0960	芒果超 媒	2021- 05-11	1,090 ,320. 00	16,800.00	14	3.3 0	1,399 .24	-	-
中信 证券	2021 0511 0000 0968	沃森生 物	2021- 05-11	1,456 ,000. 00	26,000.00	14	3.5 0	1,981 .78	-	-
中信 证券	2021 0513 0002 7746	东方财 富	2021- 05-13	305,0 00.00	10,000.00	14	3.3 0	391.4 2	-	-
中信 证券	2021 0518 0000 2865	沃森生 物	2021- 05-11	1,300 .00	-	14	3.5 0	-	-	-
中信 证券	2021 0518 0000 2924	沃森生 物	2021- 05-06	500.0 0	-	14	3.6 0	-	-	-
中信 证券	2021 0519 0000 2613	宋城演 艺	2021- 05-19	190,7 00.00	10,000.00	28	3.2 0	474.6 3	-	-
中信 证券	2021 0520 0000 0559	宋城演 艺	2021- 05-20	549,2 63.00	29,900.00	14	3.4 0	726.2 5	-	-
中信 证券	2021 0520 0001 7891	爱尔眼 科	2021- 05-20	11,64 9,000 .00	150,000.0 0	28	3.3 0	29,89 9.10	-	-
中信 证券	2021 0520 0001 7893	传音控 股	2021- 05-20	1,603 ,800. 00	10,000.00	14	2.1 0	1,309 .77	-	-
中信 证券	2021 0520 0001 7895	宋城演 艺	2021- 05-20	183,7 00.00	10,000.00	14	3.3 0	235.7 5	-	-
中信	2021	沃森生	2021-	688,4	10,000.00	14	3.5	936.9	-	-

证券	0520 0001 7897	物	05-20	00.00			0	9		
中信 证券	2021 0520 0001 7899	东方财 富	2021- 05-20	3,572 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.4 0	4,722 .98	-	-
中信 证券	2021 0520 0001 7901	东方财 富	2021- 05-20	357,2 00.00	10,000.00	14	3.4 0	472.3 0	-	-
中信 证券	2021 0520 0001 7907	温氏股 份	2021- 05-20	141,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	175.4 7	-	-
中信 证券	2021 0520 0001 7909	温氏股 份	2021- 05-20	141,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	175.4 7	-	-
中信 证券	2021 0520 0001 7941	乐普医 疗	2021- 05-20	321,9 00.00	10,000.00	14	3.3 0	413.1 1	-	-
中信 证券	2021 0525 0000 1029	温氏股 份	2021- 05-25	140,1 00.00	10,000.00	14	3.2 0	174.3 5	-	-
中信 证券	2021 0525 0000 1037	亿纬锂 能	2021- 05-25	3,647 ,860. 00	34,000.00	14	3.5 0	4,965 .14	-	-
中信 证券	2021 0525 0001 0280	温氏股 份	2021- 05-25	288,6 06.00	20,600.00	14	3.3 0	370.3 8	-	-
中信 证券	2021 0525 0001 0282	沃森生 物	2021- 05-25	1,765 ,660. 00	26,000.00	14	3.3 0	2,265 .93	-	-
中信 证券	2021 0525 0001 0286	智飞生 物	2021- 05-25	2,031 ,900. 00	10,000.00	14	3.5 0	2,765 .64	-	-
中信 证券	2021 0526	东方财 富	2021- 05-20	6,000 .00	-	14	3.4 0	-	-	-

	0001 1360									
中信 证券	2021 0526 0001 1362	东方财 富	2021- 05-20	600.0 0	-	14	3.4 0	-	-	-
中信 证券	2021 0526 0001 1496	东方财 富	2021- 05-13	600.0 0	-	14	3.3 0	-	-	-
中信 证券	2021 0526 0001 1758	东方财 富	2021- 05-20	-	20,000.00	14	3.4 0	-	-	-
中信 证券	2021 0526 0001 1760	东方财 富	2021- 05-20	-	2,000.00	14	3.4 0	-	-	-
中信 证券	2021 0526 0001 1894	东方财 富	2021- 05-13	-	2,000.00	14	3.3 0	-	-	-
中信 证券	2021 0527 0001 8719	东方财 富	2021- 05-27	314,2 00.00	10,000.00	14	3.4 0	415.4 4	-	-
中信 证券	2021 0601 0000 0692	温氏股 份	2021- 06-01	1,353 ,726. 00	95,400.00	14	3.4 0	1,789 .93	-	-
中信 证券	2021 0601 0000 0706	乐普医 疗	2021- 06-01	1,223 ,365. 00	37,700.00	14	3.3 0	1,569 .99	-	-
中信 证券	2021 0601 0000 2805	宋城演 艺	2021- 05-20	500.0 0	-	14	3.3 0	-	-	-
中信 证券	2021 0601 0000 2822	宋城演 艺	2021- 05-20	1,495 .00	-	14	3.4 0	-	-	-
中信 证券	2021 0601 0000	宋城演 艺	2021- 05-19	500.0 0	-	28	3.2 0	-	-	-

	2827									
中信 证券	2021 0603 0000 0851	亿纬锂 能	2021- 06-03	15,77 1,000 .00	150,000.0 0	14	3.4 0	20,85 2.77	-	-
中信 证券	2021 0603 0000 9788	沃森生 物	2021- 06-03	643,3 00.00	10,000.00	14	3.4 0	850.5 9	-	-
中信 证券	2021 0603 0000 9790	乐普医 疗	2021- 06-03	320,8 00.00	10,000.00	14	3.6 0	449.1 2	-	-
中信 证券	2021 0603 0000 9798	温氏股 份	2021- 06-03	141,2 00.00	10,000.00	14	3.2 0	175.7 2	-	-
中信 证券	2021 0603 0000 9800	温氏股 份	2021- 06-03	141,2 00.00	10,000.00	14	3.2 0	175.7 2	-	-
中信 证券	2021 0603 0001 0572	宋城演 艺	2021- 06-03	540,2 93.00	29,900.00	14	3.5 0	735.4 0	-	-
中信 证券	2021 0603 0001 0574	东方财 富	2021- 06-03	3,086 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.5 0	4,200 .39	-	-
中信 证券	2021 0603 0001 0576	东方财 富	2021- 06-03	308,6 00.00	10,000.00	14	3.5 0	420.0 4	-	-
中信 证券	2021 0603 0001 0590	传音控 股	2021- 06-03	1,639 ,600. 00	10,000.00	14	1.3 0	828.9 1	-	-
中信 证券	2021 0608 0000 6081	温氏股 份	2021- 06-08	306,1 16.00	20,600.00	14	3.4 0	404.7 5	-	-
中信 证券	2021 0608 0000 6085	温氏股 份	2021- 06-08	148,6 00.00	10,000.00	14	3.4 0	196.4 8	-	-

中信 证券	2021 0608 0000 6089	沃森生 物	2021- 06-08	1,721 ,460. 00	26,000.00	14	3.3 0	2,209 .21	-	-
中信 证券	2021 0608 0000 6193	智飞生 物	2021- 06-08	1,869 ,800. 00	10,000.00	14	3.3 0	2,399 .58	-	-
中信 证券	2021 0608 0000 6195	亿纬锂 能	2021- 06-08	3,322 ,820. 00	34,000.00	14	3.4 0	4,393 .51	-	-
中信 证券	2021 0609 0000 0677	温氏股 份	2021- 06-09	147,7 00.00	10,000.00	14	3.4 0	195.2 9	-	-
中信 证券	2021 0609 0000 0687	中微公 司	2021- 06-09	6,691 ,500. 00	50,000.00	28	3.9 0	20,29 7.55	-	-
中信 证券	2021 0610 0000 7776	东方财 富	2021- 06-10	312,9 00.00	10,000.00	14	3.3 0	401.5 6	-	-
中信 证券	2021 0610 0001 0288	传音控 股	2021- 06-03	10,80 0.00	-	14	1.3 0	-	-	-
中信 证券	2021 0615 0000 1748	乐普医 疗	2021- 06-15	613,2 06.00	19,800.00	14	3.4 0	810.7 9	-	-
中信 证券	2021 0615 0001 6030	温氏股 份	2021- 06-15	1,312 ,704. 00	95,400.00	14	3.4 0	1,735 .69	-	-
中信 证券	2021 0616 0000 7005	宋城演 艺	2021- 06-16	170,3 00.00	10,000.00	28	2.5 0	331.1 4	-	-
中信 证券	2021 0617 0000 1949	先导智 能	2021- 06-17	1,423 ,200. 00	24,000.00	14	3.4 0	1,881 .79	-	-
中信	2021	宋城演	2021-	504,4	29,900.00	14	2.6	510.0	-	-

证券	0617 0001 6477	艺	06-17	13.00			0	2		
中信 证券	2021 0617 0001 6479	沃森生 物	2021- 06-17	593,0 00.00	10,000.00	14	3.3 0	761.0 2	-	-
中信 证券	2021 0617 0001 6481	温氏股 份	2021- 06-17	137,5 00.00	10,000.00	14	3.4 0	181.8 1	-	-
中信 证券	2021 0617 0001 6483	温氏股 份	2021- 06-17	137,5 00.00	10,000.00	14	3.4 0	181.8 1	-	-
中信 证券	2021 0617 0001 6491	传音控 股	2021- 06-17	1,744 ,300. 00	10,000.00	14	1.4 0	949.6 7	-	-
中信 证券	2021 0617 0001 6497	亿纬锂 能	2021- 06-17	15,18 0,000 .00	150,000.0 0	14	3.4 0	20,07 1.33	-	-
中信 证券	2021 0617 0001 6499	爱尔眼 科	2021- 06-17	12,37 2,000 .00	150,000.0 0	28	3.2 0	30,79 2.53	-	-
中信 证券	2021 0617 0001 6505	乐普医 疗	2021- 06-17	309,4 00.00	10,000.00	14	3.4 0	409.1 0	-	-
中信 证券	2021 0622 0001 1720	温氏股 份	2021- 06-22	139,0 00.00	10,000.00	14	3.5 0	189.1 9	-	-
中信 证券	2021 0622 0001 1728	智飞生 物	2021- 06-22	1,712 ,900. 00	10,000.00	14	3.6 0	2,398 .06	-	-
中信 证券	2021 0622 0001 1950	亿纬锂 能	2021- 06-22	3,451 ,000. 00	34,000.00	14	3.5 0	4,697 .19	-	-
中信 证券	2021 0623	爱尔眼 科	2021- 06-17	22,24 3.40	-	28	3.2 0	-	-	-

	0001 9314									
中信 证券	2021 0623 0001 9628	爱尔眼 科	2021- 06-17	-	44,487.00	28	3.2 0	-	-	-
中信 证券	2021 0624 0000 9959	乐普医 疗	2021- 06-17	2,280 .00	-	14	3.4 0	-	-	-
中信 证券	2021 0624 0000 9998	乐普医 疗	2021- 06-15	4,514 .40	-	14	3.4 0	-	-	-
中信 证券	2021 0629 0000 1185	爱尔眼 科	2021- 06-29	1,108 ,160. 00	16,000.00	14	3.2 0	1,379 .04	-	-
中信 证券	2021 0629 0001 7983	温氏股 份	2021- 06-29	1,370 ,898. 00	95,400.00	14	3.0 0	1,599 .38	-	-
中信 证券	2021 0701 0000 0844	沃森生 物	2021- 07-01	601,5 00.00	10,000.00	14	3.5 0	818.7 1	-	-
中信 证券	2021 0701 0001 5860	先导智 能	2021- 07-01	1,392 ,000. 00	24,000.00	14	3.5 0	1,894 .67	-	-
中信 证券	2021 0701 0001 5862	宋城演 艺	2021- 07-01	510,3 93.00	29,900.00	14	3.1 0	615.3 1	-	-
中信 证券	2021 0701 0001 5864	沃森生 物	2021- 07-01	601,5 00.00	10,000.00	14	3.6 0	842.1 0	-	-
中信 证券	2021 0701 0001 5866	温氏股 份	2021- 07-01	141,4 00.00	10,000.00	14	3.0 0	164.9 7	-	-
中信 证券	2021 0701 0001	温氏股 份	2021- 07-01	141,4 00.00	10,000.00	14	3.0 0	164.9 7	-	-

	5868									
中信 证券	2021 0701 0001 5870	亿纬锂 能	2021- 07-01	15,45 0,000 .00	150,000.0 0	14	3.4 0	20,42 8.33	-	-
中信 证券	2021 0701 0001 5880	传音控 股	2021- 07-01	2,056 ,000. 00	10,000.00	14	3.2 0	2,558 .58	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1132	贝达药 业	2021- 07-02	673,7 25.00	15,300.00	7	3.5 0	1,079 .26	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1149	先导智 能	2021- 07-02	1,543 ,590. 00	63,600.00	7	3.5 0	2,474 .51	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1161	华大基 因	2021- 07-02	624,3 05.00	13,000.00	7	3.4 0	975.5 6	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1167	中微公 司	2021- 07-02	1,515 ,000. 00	20,000.00	7	4.4 0	2,592 .33	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1173	亿联网 络	2021- 07-02	576,1 00.00	16,500.00	7	3.6 0	950.5 7	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1185	同花顺	2021- 07-02	598,2 35.00	13,000.00	7	3.4 0	934.8 2	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1193	智飞生 物	2021- 07-02	3,900 ,100. 00	50,600.00	7	3.6 0	6,425 .19	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1199	乐普医 疗	2021- 07-02	1,036 ,825. 00	78,900.00	7	3.5 0	1,661 .89	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1203	沃森生 物	2021- 07-02	2,482 ,200. 00	98,900.00	7	3.6 0	4,091 .49	-	-

中信 证券	2021 0702 0000 1213	康泰生 物	2021- 07-02	1,594 ,120. 00	25,900.00	7	4.5 0	3,284 .25	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1216	三环集 团	2021- 07-02	1,175 ,660. 00	68,300.00	7	3.5 0	1,884 .38	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1226	泰格医 药	2021- 07-02	2,687 ,580. 00	33,000.00	7	4.0 0	4,927 .23	-	-
中信 证券	2021 0702 0000 1243	阳光电 源	2021- 07-02	2,837 ,430. 00	63,600.00	7	3.6 0	4,678 .61	-	-
中信 证券	2021 0706 0001 1496	智飞生 物	2021- 07-06	1,720 ,100. 00	10,000.00	14	3.5 0	2,341 .25	-	-
中信 证券	2021 0706 0001 1500	温氏股 份	2021- 07-06	142,7 00.00	10,000.00	14	3.5 0	194.2 3	-	-
中信 证券	2021 0706 0001 1502	亿纬锂 能	2021- 07-06	3,452 ,700. 00	34,000.00	14	3.4 0	4,565 .24	-	-
中信 证券	2021 0706 0001 2815	华大基 因	2021- 07-02	4,550 .00	-	7	3.4 0	-	-	-
中信 证券	2021 0707 0001 6917	中微公 司	2021- 07-07	8,252 ,000. 00	50,000.00	28	4.2 0	26,95 6.53	-	-
中信 证券	2021 0707 0001 7753	温氏股 份	2021- 07-06	2,000 .00	-	14	3.5 0	-	-	-
中信 证券	2021 0707 0001 7807	温氏股 份	2021- 07-01	2,000 .00	-	14	3.0 0	-	-	-
中信	2021	温氏股	2021-	2,000	-	14	3.0	-	-	-

证券	0707 0001 7809	份	07-01	.00			0			
中信 证券	2021 0707 0001 7859	温氏股 份	2021- 06-29	19,08 0.00	-	14	3.0 0	-	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6317	华大基 因	2021- 07-09	616,0 00.00	5,500.00	7	2.7 0	323.4 0	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6319	中微公 司	2021- 07-09	1,780 ,400. 00	10,000.00	7	5.1 0	1,765 .56	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6321	沃森生 物	2021- 07-09	2,714 ,460. 00	42,000.00	7	2.7 0	1,425 .09	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6323	阳光电 源	2021- 07-09	3,186 ,000. 00	27,000.00	7	2.8 0	1,734 .60	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6325	泰格医 药	2021- 07-09	2,210 ,600. 00	14,000.00	7	2.6 0	1,117 .58	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6327	乐普医 疗	2021- 07-09	958,1 00.00	33,500.00	7	3.2 0	596.1 5	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6329	同花顺	2021- 07-09	572,7 70.00	5,500.00	7	3.4 0	378.6 6	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6331	智飞生 物	2021- 07-09	3,763 ,145. 00	21,500.00	7	2.8 0	2,048 .82	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6333	亿联网 络	2021- 07-09	584,7 10.00	7,000.00	7	2.7 0	306.9 7	-	-
中信 证券	2021 0709	康泰生 物	2021- 07-09	1,534 ,500.	11,000.00	7	2.8 0	835.4 5	-	-

	0000 6337			00						
中信 证券	2021 0709 0000 6339	三环集 团	2021- 07-09	1,227 ,570. 00	29,000.00	7	2.7 0	644.4 7	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6341	先导智 能	2021- 07-09	1,771 ,470. 00	27,000.00	7	2.8 0	964.4 7	-	-
中信 证券	2021 0709 0000 6343	贝达药 业	2021- 07-09	606,3 85.00	6,500.00	7	2.8 0	330.1 4	-	-
中信 证券	2021 0713 0002 1389	爱尔眼 科	2021- 07-13	1,060 ,800. 00	16,000.00	14	2.9 0	1,196 .35	-	-
中信 证券	2021 0714 0000 6962	宋城演 艺	2021- 07-14	161,7 00.00	10,000.00	28	3.2 0	402.4 5	-	-
中信 证券	2021 0715 0001 5714	沃森生 物	2021- 07-15	674,0 00.00	10,000.00	14	2.6 0	681.4 9	-	-
中信 证券	2021 0715 0001 5716	宋城演 艺	2021- 07-15	482,8 85.00	29,900.00	14	3.3 0	619.7 0	-	-
中信 证券	2021 0715 0001 5728	亿纬锂 能	2021- 07-15	19,05 0,000 .00	150,000.0 0	14	3.2 0	23,70 6.67	-	-
中信 证券	2021 0715 0001 7568	爱尔眼 科	2021- 07-15	10,05 3,000 .00	150,000.0 0	28	2.8 0	21,89 3.20	-	-
中信 证券	2021 0715 0001 7570	沃森生 物	2021- 07-15	674,0 00.00	10,000.00	14	2.6 0	681.4 9	-	-
中信 证券	2021 0715 0001	温氏股 份	2021- 07-15	135,5 00.00	10,000.00	14	3.4 0	179.1 6	-	-

	7576									
中信 证券	2021 0715 0001 7596	温氏股 份	2021- 07-15	135,5 00.00	10,000.00	14	3.4 0	179.1 6	-	-
中信 证券	2021 0715 0001 7600	先导智 能	2021- 07-15	1,616 ,160. 00	24,000.00	14	2.7 0	1,696 .97	-	-
中信 证券	2021 0720 0001 2065	温氏股 份	2021- 07-20	127,7 00.00	10,000.00	14	1.9 0	94.36	-	-
中信 证券	2021 0720 0001 3615	亿纬锂 能	2021- 07-20	4,028 ,660. 00	34,000.00	14	2.5 0	3,916 .75	-	-
中信 证券	2021 0720 0001 3617	智飞生 物	2021- 07-20	1,941 ,300. 00	10,000.00	14	2.3 0	1,736 .39	-	-
中信 证券	2021 0727 0001 8619	爱尔眼 科	2021- 07-27	883,5 20.00	16,000.00	28	3.0 0	2,061 .55	-	-
中信 证券	2021 0729 0001 5735	温氏股 份	2021- 07-29	123,8 00.00	10,000.00	28	2.6 0	250.3 5	-	-
中信 证券	2021 0729 0001 5739	温氏股 份	2021- 07-29	123,8 00.00	10,000.00	28	2.6 0	250.3 5	-	-
中信 证券	2021 0729 0001 6257	宋城演 艺	2021- 07-29	398,5 67.00	29,900.00	28	2.4 0	743.9 9	-	-
中信 证券	2021 0729 0001 6267	沃森生 物	2021- 07-29	829,2 00.00	10,000.00	28	2.0 0	1,289 .87	-	-
中信 证券	2021 0729 0001 6269	沃森生 物	2021- 07-29	829,2 00.00	10,000.00	28	2.0 0	1,289 .87	-	-

中信 证券	2021 0729 0001 6271	亿纬锂 能	2021- 07-29	16,56 1,500 .00	150,000.0 0	28	2.9 0	37,35 5.38	-	-
中信 证券	2021 0729 0001 6721	先导智 能	2021- 07-29	1,686 ,000. 00	24,000.00	28	2.5 0	3,278 .33	-	-
中信 证券	2021 0803 0001 2978	亿纬锂 能	2021- 08-03	3,745 ,100. 00	34,000.00	14	2.7 0	3,932 .36	-	-
中信 证券	2021 0803 0001 2980	智飞生 物	2021- 08-03	1,749 ,100. 00	10,000.00	14	2.4 0	1,632 .49	-	-
中信 证券	2021 0803 0001 2982	温氏股 份	2021- 08-03	133,5 00.00	10,000.00	14	3.4 0	176.5 2	-	-
中信 证券	2021 0804 0001 7536	中微公 司	2021- 08-04	9,750 ,000. 00	50,000.00	28	5.0 0	37,91 6.67	-	-
中信 证券	2021 0805 0001 0555	康泰生 物	2021- 07-09	10,63 4.31	-	7	2.8 0	-	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0960	沪硅产 业	2021- 08-10	410,5 30.00	12,200.00	28	2.5 0	798.2 5	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0962	澜起科 技	2021- 08-10	863,1 48.00	13,200.00	28	2.4 0	1,611 .21	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0964	中国通 号	2021- 08-10	100,7 82.00	19,800.00	28	2.0 0	156.7 7	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0972	英科医 疗	2021- 08-10	592,7 04.00	5,400.00	28	3.0 0	1,382 .98	-	-
中信	2021	华大基	2021-	597,3	5,500.00	28	3.2	1,486	-	-

证券	0810 0000 0974	因	08-10	00.00			0	.61		
中信 证券	2021 0810 0000 0976	亿联网 络	2021- 08-10	114,8 42.00	1,300.00	28	2.2 0	196.5 1	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0978	康泰生 物	2021- 08-10	266,1 71.00	1,900.00	28	2.8 0	579.6 6	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0980	爱尔眼 科	2021- 08-10	732,9 17.00	12,700.00	28	2.5 0	1,425 .12	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0982	亿纬锂 能	2021- 08-10	2,185 ,920. 00	19,800.00	28	2.4 0	4,080 .38	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0984	乐普医 疗	2021- 08-10	532,4 22.00	19,800.00	28	2.7 0	1,118 .09	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0986	智飞生 物	2021- 08-10	632,6 24.00	3,800.00	28	2.9 0	1,426 .92	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0988	东方财 富	2021- 08-10	1,408 ,660. 00	41,800.00	28	3.1 0	3,396 .44	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0990	同花顺	2021- 08-10	99,29 0.00	1,000.00	28	3.1 0	239.4 0	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0992	汇川技 术	2021- 08-10	622,3 25.00	7,300.00	28	2.5 0	1,210 .08	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 0994	温氏股 份	2021- 08-10	287,3 75.00	20,900.00	28	3.3 0	737.6 0	-	-
中信 证券	2021 0810	先导智 能	2021- 08-10	341,0 88.00	4,400.00	28	2.3 0	610.1 7	-	-

	0000 0996									
中信 证券	2021 0810 0000 0998	蓝思科 技	2021- 08-10	185,9 20.00	7,000.00	28	2.5 0	361.5 1	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 1000	欧普康 视	2021- 08-10	224,0 16.00	2,400.00	28	2.8 0	487.8 6	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 1002	健帆生 物	2021- 08-10	109,0 60.00	1,900.00	28	3.4 0	288.4 0	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 1004	贝达药 业	2021- 08-10	101,6 07.00	1,100.00	28	3.0 0	237.0 8	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 1006	芒果超 媒	2021- 08-10	768,9 00.00	13,200.00	28	2.8 0	1,674 .49	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 1008	宋城演 艺	2021- 08-10	99,16 0.00	7,400.00	28	3.4 0	262.2 2	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 1010	沃森生 物	2021- 08-10	646,0 50.00	7,300.00	28	2.5 0	1,256 .21	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 1012	信维通 信	2021- 08-10	354,5 52.00	13,200.00	28	2.9 0	799.7 1	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 1014	三环集 团	2021- 08-10	227,8 68.00	5,100.00	28	2.7 0	478.5 2	-	-
中信 证券	2021 0810 0000 1016	泰格医 药	2021- 08-10	409,5 00.00	2,500.00	28	2.3 0	732.5 5	-	-
中信 证券	2021 0810 0000	阳光电 源	2021- 08-10	1,065 ,774. 00	6,900.00	28	2.9 0	2,403 .91	-	-

	1018									
中信 证券	2021 0810 0000 1082	东方财 富	2021- 08-10	67,40 0.00	2,000.00	14	3.2 0	83.88	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1410	沪硅产 业	2021- 08-11	401,5 02.00	12,200.00	28	2.5 0	780.7 0	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1412	中国通 号	2021- 08-11	101,5 74.00	19,800.00	28	2.0 0	158.0 0	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1414	澜起科 技	2021- 08-11	849,0 24.00	13,200.00	28	2.4 0	1,584 .84	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1420	英科医 疗	2021- 08-11	590,2 20.00	5,400.00	28	3.0 0	1,377 .18	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1422	华大基 因	2021- 08-11	592,0 75.00	5,500.00	28	3.2 0	1,473 .61	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1424	亿联网 络	2021- 08-11	113,5 03.00	1,300.00	28	2.2 0	194.2 2	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1426	康泰生 物	2021- 08-11	254,6 19.00	1,900.00	28	2.8 0	554.5 0	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1428	爱尔眼 科	2021- 08-11	705,3 58.00	12,700.00	28	2.5 0	1,371 .53	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1430	亿纬锂 能	2021- 08-11	2,246 ,112. 00	19,800.00	28	2.4 0	4,192 .74	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1432	乐普医 疗	2021- 08-11	525,0 96.00	19,800.00	28	2.7 0	1,102 .70	-	-

中信 证券	2021 0811 0000 1434	智飞生 物	2021- 08-11	621,2 24.00	3,800.00	28	2.9 0	1,401 .21	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1436	东方财 富	2021- 08-11	1,377 ,728. 00	41,800.00	28	3.1 0	3,321 .86	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1438	同花顺	2021- 08-11	98,49 0.00	1,000.00	28	3.1 0	237.4 7	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1440	汇川技 术	2021- 08-11	603,0 53.00	7,300.00	28	2.5 0	1,172 .60	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1442	温氏股 份	2021- 08-11	285,0 76.00	20,900.00	28	3.3 0	731.7 0	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1444	先导智 能	2021- 08-11	335,9 40.00	4,400.00	28	2.3 0	600.9 6	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1448	蓝思科 技	2021- 08-11	179,3 40.00	7,000.00	28	2.5 0	348.7 2	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1450	欧普康 视	2021- 08-11	215,9 76.00	2,400.00	28	2.8 0	470.3 5	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1452	贝达药 业	2021- 08-11	99,11 0.00	1,100.00	28	3.0 0	231.2 6	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1454	健帆生 物	2021- 08-11	108,5 28.00	1,900.00	28	3.4 0	287.0 0	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1456	芒果超 媒	2021- 08-11	762,5 64.00	13,200.00	28	2.8 0	1,660 .69	-	-
中信	2021	宋城演	2021-	98,05	7,400.00	28	3.4	259.2	-	-

证券	0811 0000 1458	艺	08-11	0.00			0	9		
中信 证券	2021 0811 0000 1460	沃森生 物	2021- 08-11	611,5 94.00	7,300.00	28	2.5 0	1,189 .21	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1462	信维通 信	2021- 08-11	354,8 16.00	13,200.00	28	2.9 0	800.3 1	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1464	三环集 团	2021- 08-11	228,1 74.00	5,100.00	28	2.7 0	479.1 7	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1466	泰格医 药	2021- 08-11	404,7 75.00	2,500.00	28	2.3 0	724.1 0	-	-
中信 证券	2021 0811 0000 1474	阳光电 源	2021- 08-11	1,056 ,528. 00	6,900.00	28	2.9 0	2,383 .06	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0911	中国通 号	2021- 08-12	100,9 80.00	19,800.00	28	2.0 0	157.0 8	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0913	沪硅产 业	2021- 08-12	405,2 84.00	12,200.00	28	2.5 0	788.0 5	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0915	澜起科 技	2021- 08-12	850,0 80.00	13,200.00	28	2.4 0	1,586 .82	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0957	乐普医 疗	2021- 08-12	524,7 00.00	19,800.00	28	2.7 0	1,101 .87	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0959	东方财 富	2021- 08-12	1,340 ,108. 00	41,800.00	28	3.1 0	3,231 .15	-	-
中信 证券	2021 0812	智飞生 物	2021- 08-12	617,5 00.00	3,800.00	28	2.9 0	1,392 .81	-	-

	0000 0961									
中信 证券	2021 0812 0000 0963	同花顺	2021- 08-12	96,88 0.00	1,000.00	28	3.1 0	233.5 9	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0965	亿纬锂 能	2021- 08-12	2,225 ,124. 00	19,800.00	28	2.4 0	4,153 .56	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0967	爱尔眼 科	2021- 08-12	695,7 06.00	12,700.00	28	2.5 0	1,352 .76	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0969	汇川技 术	2021- 08-12	540,0 54.00	7,300.00	28	2.5 0	1,050 .11	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0971	亿联网 络	2021- 08-12	113,5 81.00	1,300.00	28	2.2 0	194.3 5	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0973	华大基 因	2021- 08-12	586,0 80.00	5,500.00	28	3.2 0	1,458 .69	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0975	康泰生 物	2021- 08-12	256,6 71.00	1,900.00	28	2.8 0	558.9 7	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0977	贝达药 业	2021- 08-12	100,5 40.00	1,100.00	28	3.0 0	234.5 9	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0979	欧普康 视	2021- 08-12	214,0 80.00	2,400.00	28	2.8 0	466.2 2	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0981	英科医 疗	2021- 08-12	582,7 14.00	5,400.00	28	3.0 0	1,359 .67	-	-
中信 证券	2021 0812 0000	阳光电 源	2021- 08-12	1,035 ,069. 00	6,900.00	28	2.9 0	2,334 .66	-	-

	0983									
中信 证券	2021 0812 0000 0985	泰格医 药	2021- 08-12	387,5 00.00	2,500.00	28	2.3 0	693.1 9	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0987	宋城演 艺	2021- 08-12	96,12 6.00	7,400.00	28	3.4 0	254.2 0	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0989	信维通 信	2021- 08-12	352,0 44.00	13,200.00	28	2.9 0	794.0 5	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0991	沃森生 物	2021- 08-12	589,6 94.00	7,300.00	28	2.5 0	1,146 .63	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0993	三环集 团	2021- 08-12	241,9 95.00	5,100.00	28	2.7 0	508.1 9	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0995	温氏股 份	2021- 08-12	282,3 59.00	20,900.00	28	3.3 0	724.7 2	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0997	健帆生 物	2021- 08-12	109,2 31.00	1,900.00	28	3.4 0	288.8 6	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 0999	先导智 能	2021- 08-12	338,8 88.00	4,400.00	28	2.3 0	606.2 3	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 1001	芒果超 媒	2021- 08-12	753,7 20.00	13,200.00	28	2.8 0	1,641 .43	-	-
中信 证券	2021 0812 0000 1003	蓝思科 技	2021- 08-12	177,5 20.00	7,000.00	28	2.5 0	345.1 8	-	-
中信 证券	2021 0812 0001 8385	爱尔眼 科	2021- 08-12	8,217 ,000. 00	150,000.0 0	28	2.8 0	17,89 4.80	-	-

中信 证券	2021 0817 0000 0797	爱尔眼 科	2021- 08-17	2,059 ,200. 00	39,600.00	28	2.5 0	4,004 .00	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0799	中国通 号	2021- 08-17	201,1 68.00	39,600.00	28	1.8 0	281.6 4	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0801	沪硅产 业	2021- 08-17	399,6 96.00	13,200.00	28	3.0 0	932.6 2	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0803	澜起科 技	2021- 08-17	785,4 00.00	13,200.00	28	2.3 0	1,404 .99	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0841	康泰生 物	2021- 08-17	892,2 54.00	6,600.00	28	2.8 0	1,943 .13	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0843	亿联网 络	2021- 08-17	564,9 60.00	6,600.00	28	2.2 0	966.7 1	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0847	信维通 信	2021- 08-17	337,9 20.00	13,200.00	28	2.8 0	735.9 1	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0849	沃森生 物	2021- 08-17	1,953 ,600. 00	26,400.00	28	2.6 0	3,950 .61	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0851	汇川技 术	2021- 08-17	1,405 ,800. 00	19,800.00	28	2.2 0	2,405 .48	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0853	东方财 富	2021- 08-17	3,884 ,892. 00	125,400.0 0	28	3.2 0	9,669 .06	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0855	智飞生 物	2021- 08-17	1,986 ,600. 00	13,200.00	28	2.5 0	3,862 .83	-	-
中信	2021	三环集	2021-	548,3	13,200.00	28	2.3	980.9	-	-

证券	0817 0000 0857	团	08-17	28.00			0	0		
中信 证券	2021 0817 0000 0859	芒果超 媒	2021- 08-17	703,5 60.00	13,200.00	28	2.8 0	1,532 .20	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0861	泰格医 药	2021- 08-17	943,3 38.00	6,600.00	28	2.5 0	1,834 .27	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0863	宋城演 艺	2021- 08-17	356,1 36.00	26,400.00	28	3.4 0	941.7 8	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0865	阳光电 源	2021- 08-17	1,910 ,040. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,011 .08	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0867	同花顺	2021- 08-17	681,9 12.00	6,600.00	28	2.8 0	1,485 .05	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0869	乐普医 疗	2021- 08-17	518,5 62.00	19,800.00	28	2.8 0	1,129 .31	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0871	健帆生 物	2021- 08-17	356,4 00.00	6,600.00	28	3.0 0	831.6 0	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0873	贝达药 业	2021- 08-17	582,7 80.00	6,600.00	28	2.3 0	1,042 .53	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0875	温氏股 份	2021- 08-17	864,6 00.00	66,000.00	28	3.3 0	2,219 .14	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0877	蓝思科 技	2021- 08-17	479,5 56.00	19,800.00	28	2.2 0	820.5 7	-	-
中信 证券	2021 0817	先导智 能	2021- 08-17	962,9 40.00	13,200.00	28	2.3 0	1,722 .59	-	-

	0000 0879									
中信 证券	2021 0817 0000 0881	华大基 因	2021- 08-17	673,9 26.00	6,600.00	28	2.8 0	1,467 .66	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0883	英科医 疗	2021- 08-17	731,2 80.00	6,600.00	28	3.2 0	1,820 .07	-	-
中信 证券	2021 0817 0000 0885	欧普康 视	2021- 08-17	533,2 80.00	6,600.00	28	2.6 0	1,078 .41	-	-
中信 证券	2021 0817 0001 2906	温氏股 份	2021- 08-17	131,0 00.00	10,000.00	14	3.4 0	173.2 1	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0800	中国通 号	2021- 08-20	201,5 64.00	39,600.00	28	1.8 0	282.1 9	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0802	沪硅产 业	2021- 08-20	409,5 96.00	13,200.00	28	3.0 0	955.7 2	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0804	澜起科 技	2021- 08-20	778,8 00.00	13,200.00	28	2.3 0	1,393 .19	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0860	英科医 疗	2021- 08-20	676,3 02.00	6,600.00	28	3.2 0	1,683 .24	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0874	亿联网 络	2021- 08-20	566,2 80.00	6,600.00	28	2.2 0	968.9 7	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0876	华大基 因	2021- 08-20	654,1 92.00	6,600.00	28	2.8 0	1,424 .68	-	-
中信 证券	2021 0820 0000	爱尔眼 科	2021- 08-20	1,851 ,300. 00	39,600.00	28	2.5 0	3,599 .75	-	-

	0878									
中信 证券	2021 0820 0000 0880	同花顺	2021- 08-20	719,6 64.00	6,600.00	28	2.8 0	1,567 .27	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0882	乐普医 疗	2021- 08-20	490,0 50.00	19,800.00	28	2.8 0	1,067 .22	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0884	亿纬锂 能	2021- 08-20	1,950 ,300. 00	19,800.00	28	2.4 0	3,640 .56	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0886	先导智 能	2021- 08-20	1,001 ,484. 00	13,200.00	28	2.3 0	1,791 .54	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0888	温氏股 份	2021- 08-20	858,0 00.00	66,000.00	28	3.3 0	2,202 .20	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0890	芒果超 媒	2021- 08-20	703,0 32.00	13,200.00	28	2.8 0	1,531 .05	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0892	蓝思科 技	2021- 08-20	497,7 72.00	19,800.00	28	2.2 0	851.7 4	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0894	欧普康 视	2021- 08-20	500,2 80.00	6,600.00	28	2.6 0	1,011 .68	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0896	康泰生 物	2021- 08-20	857,0 76.00	6,600.00	28	2.8 0	1,866 .52	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0898	健帆生 物	2021- 08-20	341,4 84.00	6,600.00	28	3.0 0	796.8 0	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0900	三环集 团	2021- 08-20	516,1 20.00	13,200.00	28	2.3 0	923.2 8	-	-

中信 证券	2021 0820 0000 0902	贝达药 业	2021- 08-20	538,6 26.00	6,600.00	28	2.3 0	963.5 4	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0904	汇川技 术	2021- 08-20	1,373 ,724. 00	19,800.00	28	2.2 0	2,350 .59	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0906	信维通 信	2021- 08-20	330,5 28.00	13,200.00	28	2.8 0	719.8 2	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0908	东方财 富	2021- 08-20	3,938 ,814. 00	125,400.0 0	28	3.2 0	9,803 .27	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0910	智飞生 物	2021- 08-20	1,914 ,660. 00	13,200.00	28	2.5 0	3,722 .95	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0912	阳光电 源	2021- 08-20	1,818 ,960. 00	13,200.00	28	2.7 0	3,819 .82	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0914	泰格医 药	2021- 08-20	896,7 42.00	6,600.00	28	2.5 0	1,743 .67	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0916	沃森生 物	2021- 08-20	2,144 ,472. 00	26,400.00	28	2.6 0	4,336 .60	-	-
中信 证券	2021 0820 0000 0918	宋城演 艺	2021- 08-20	359,3 04.00	26,400.00	28	3.4 0	950.1 6	-	-
中信 证券	2021 0824 0001 8359	爱尔眼 科	2021- 08-24	792,8 00.00	16,000.00	28	2.5 0	1,596 .62	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0912	中国通 号	2021- 08-26	202,7 52.00	39,600.00	28	2.4 0	378.4 7	-	-
中信	2021	沪硅产	2021-	382,8	13,200.00	28	2.9	863.4	-	-

证券	0826 0000 0914	业	08-26	00.00			0	3		
中信 证券	2021 0826 0000 0916	澜起科 技	2021- 08-26	764,4 12.00	13,200.00	28	3.0 0	1,783 .63	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0942	亿纬锂 能	2021- 08-26	1,908 ,522. 00	19,800.00	28	2.4 0	3,562 .57	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0944	爱尔眼 科	2021- 08-26	1,928 ,916. 00	39,600.00	28	2.5 0	3,750 .67	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0946	乐普医 疗	2021- 08-26	497,3 76.00	19,800.00	28	2.9 0	1,121 .86	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0948	汇川技 术	2021- 08-26	1,470 ,546. 00	19,800.00	28	2.9 0	3,316 .90	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0950	信维通 信	2021- 08-26	307,2 96.00	13,200.00	28	2.3 0	549.7 2	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0952	智飞生 物	2021- 08-26	2,082 ,828. 00	13,200.00	28	2.4 0	3,887 .95	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0954	同花顺	2021- 08-26	740,1 90.00	6,600.00	28	3.2 0	1,842 .25	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0956	东方财 富	2021- 08-26	3,884 ,892. 00	125,400.0 0	28	3.1 0	9,366 .91	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0962	亿联网 络	2021- 08-26	538,8 90.00	6,600.00	28	2.1 0	880.1 9	-	-
中信 证券	2021 0826	华大基 因	2021- 08-26	650,7 60.00	6,600.00	28	3.1 0	1,569 .05	-	-

	0000 0964									
中信 证券	2021 0826 0000 0966	康泰生 物	2021- 08-26	825,8 58.00	6,600.00	28	3.3 0	2,119 .70	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0968	贝达药 业	2021- 08-26	519,1 56.00	6,600.00	28	3.1 0	1,251 .74	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0970	欧普康 视	2021- 08-26	496,7 16.00	6,600.00	28	2.9 0	1,120 .37	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0972	泰格医 药	2021- 08-26	934,2 30.00	6,600.00	28	2.5 0	1,816 .56	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0974	三环集 团	2021- 08-26	515,9 88.00	13,200.00	28	2.9 0	1,163 .84	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0976	阳光电 源	2021- 08-26	1,980 ,660. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,159 .39	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0978	沃森生 物	2021- 08-26	2,216 ,016. 00	26,400.00	28	2.7 0	4,653 .63	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0980	宋城演 艺	2021- 08-26	388,0 80.00	26,400.00	28	3.4 0	1,026 .26	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0982	温氏股 份	2021- 08-26	881,1 00.00	66,000.00	28	3.2 0	2,192 .96	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0984	健帆生 物	2021- 08-26	332,5 08.00	6,600.00	28	3.1 0	801.7 1	-	-
中信 证券	2021 0826 0000	先导智 能	2021- 08-26	943,2 72.00	13,200.00	28	2.9 0	2,127 .60	-	-

	0986									
中信 证券	2021 0826 0000 0988	芒果超 媒	2021- 08-26	690,3 60.00	13,200.00	28	3.2 0	1,718 .23	-	-
中信 证券	2021 0826 0000 0990	蓝思科 技	2021- 08-26	479,1 60.00	19,800.00	28	2.9 0	1,080 .77	-	-
中信 证券	2021 0826 0001 4793	温氏股 份	2021- 08-26	133,5 00.00	10,000.00	28	3.3 0	342.6 5	-	-
中信 证券	2021 0826 0001 4795	温氏股 份	2021- 08-26	133,5 00.00	10,000.00	28	3.3 0	342.6 5	-	-
中信 证券	2021 0826 0001 4797	宋城演 艺	2021- 08-26	439,5 30.00	29,900.00	28	3.4 0	1,162 .31	-	-
中信 证券	2021 0826 0001 4799	亿纬锂 能	2021- 08-26	14,45 8,500 .00	150,000.0 0	28	2.4 0	26,98 9.20	-	-
中信 证券	2021 0826 0001 4801	沃森生 物	2021- 08-26	839,4 00.00	10,000.00	28	2.6 0	1,697 .45	-	-
中信 证券	2021 0826 0001 4803	沃森生 物	2021- 08-26	839,4 00.00	10,000.00	28	2.6 0	1,697 .45	-	-
中信 证券	2021 0901 0001 9793	中微公 司	2021- 09-01	7,915 ,000. 00	50,000.00	28	3.2 0	19,69 9.56	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1943	爱尔眼 科	2021- 09-07	571,6 27.00	12,700.00	28	3.0 0	1,476 .71	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1945	康泰生 物	2021- 09-07	223,9 91.00	1,900.00	28	3.2 0	617.2 2	-	-

中信 证券	2021 0907 0002 1947	沪硅产 业	2021- 09-07	365,5 12.00	12,200.00	28	3.3 0	1,038 .67	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1949	亿联网 络	2021- 09-07	108,0 30.00	1,300.00	28	2.9 0	269.7 8	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1951	乐普医 疗	2021- 09-07	527,2 74.00	19,800.00	28	2.9 0	1,316 .72	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1953	亿纬锂 能	2021- 09-07	1,989 ,900. 00	19,800.00	28	3.1 0	5,311 .93	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1955	智飞生 物	2021- 09-07	626,5 06.00	3,800.00	28	2.6 0	1,402 .67	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1957	东方财 富	2021- 09-07	1,429 ,560. 00	41,800.00	28	3.2 0	3,939 .24	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1959	中国通 号	2021- 09-07	107,1 18.00	19,800.00	28	2.9 0	267.5 0	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1961	澜起科 技	2021- 09-07	774,3 12.00	13,200.00	28	3.0 0	2,000 .31	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1963	华大基 因	2021- 09-07	531,6 30.00	5,500.00	28	3.1 0	1,419 .16	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1965	英科医 疗	2021- 09-07	542,1 06.00	5,400.00	28	3.2 0	1,493 .80	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1967	沃森生 物	2021- 09-07	568,5 24.00	7,300.00	28	2.8 0	1,370 .78	-	-
中信	2021	泰格医	2021-	361,0	2,500.00	28	2.5	777.2	-	-

证券	0907 0002 1969	药	09-07	25.00			0	0		
中信 证券	2021 0907 0002 1971	汇川技 术	2021- 09-07	532,0 97.00	7,300.00	28	2.6 0	1,191 .31	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1973	温氏股 份	2021- 09-07	284,4 49.00	20,900.00	28	3.3 0	808.3 1	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1975	同花顺	2021- 09-07	134,9 20.00	1,000.00	28	3.2 0	371.7 8	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1977	阳光电 源	2021- 09-07	979,8 00.00	6,900.00	28	2.9 0	2,446 .78	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 1979	蓝思科 技	2021- 09-07	170,8 70.00	7,000.00	28	3.0 0	441.4 2	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 2131	欧普康 视	2021- 09-07	160,7 52.00	2,400.00	28	2.6 0	359.9 1	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 2133	健帆生 物	2021- 09-07	96,33 0.00	1,900.00	28	3.2 0	265.4 4	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 2135	三环集 团	2021- 09-07	189,9 24.00	5,100.00	28	2.5 0	408.8 7	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 2137	信维通 信	2021- 09-07	319,0 44.00	13,200.00	28	2.8 0	769.2 5	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 2139	宋城演 艺	2021- 09-07	118,3 26.00	7,400.00	28	3.1 0	315.8 7	-	-
中信 证券	2021 0907	芒果超 媒	2021- 09-07	588,5 88.00	13,200.00	28	3.0 0	1,520 .52	-	-

	0002 2141									
中信 证券	2021 0907 0002 2143	先导智 能	2021- 09-07	311,1 24.00	4,400.00	28	3.0 0	803.7 4	-	-
中信 证券	2021 0907 0002 2145	贝达药 业	2021- 09-07	94,71 0.00	1,100.00	28	3.2 0	260.9 8	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0857	中国通 号	2021- 09-08	60,06 0.00	11,000.00	28	1.9 0	95.10	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0859	沪硅产 业	2021- 09-08	111,0 00.00	3,700.00	28	3.1 0	286.7 5	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0861	澜起科 技	2021- 09-08	215,7 10.00	3,700.00	28	2.3 0	413.4 4	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0873	乐普医 疗	2021- 09-08	144,8 70.00	5,500.00	28	2.3 0	277.6 7	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0875	华大基 因	2021- 09-08	172,5 84.00	1,800.00	28	2.3 0	330.7 8	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0877	亿纬锂 能	2021- 09-08	547,7 45.00	5,500.00	28	2.6 0	1,186 .78	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0879	东方财 富	2021- 09-08	882,2 50.00	25,000.00	28	2.9 0	2,132 .10	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0881	智飞生 物	2021- 09-08	591,6 30.00	3,700.00	28	2.2 0	1,084 .65	-	-
中信 证券	2021 0908 0000	爱尔眼 科	2021- 09-08	492,9 10.00	11,000.00	28	2.7 0	1,109 .05	-	-

	0883									
中信 证券	2021 0908 0000 0885	同花顺	2021- 09-08	247,1 58.00	1,800.00	28	2.9 0	597.3 0	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0887	蓝思科 技	2021- 09-08	138,2 70.00	5,500.00	28	1.8 0	207.4 1	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0889	温氏股 份	2021- 09-08	249,2 46.00	18,300.00	28	3.2 0	664.6 6	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0891	健帆生 物	2021- 09-08	90,43 2.00	1,800.00	28	3.2 0	241.1 6	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0893	先导智 能	2021- 09-08	254,3 75.00	3,700.00	28	3.1 0	657.1 4	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0895	康泰生 物	2021- 09-08	209,7 54.00	1,800.00	28	2.9 0	506.9 0	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0897	贝达药 业	2021- 09-08	153,5 58.00	1,800.00	28	2.6 0	332.7 1	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0899	亿联网 络	2021- 09-08	149,7 24.00	1,800.00	28	2.6 0	324.4 1	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0901	欧普康 视	2021- 09-08	119,6 46.00	1,800.00	28	2.7 0	269.2 1	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0903	沃森生 物	2021- 09-08	564,2 90.00	7,300.00	28	2.5 0	1,175 .60	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0905	宋城演 艺	2021- 09-08	117,1 65.00	7,300.00	28	3.7 0	361.2 5	-	-

中信 证券	2021 0908 0000 0907	汇川技术	2021- 09-08	385,0 00.00	5,500.00	28	2.7 0	866.2 5	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0909	三环集团	2021- 09-08	138,6 39.00	3,700.00	28	2.8 0	323.4 9	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0911	信维通信	2021- 09-08	90,83 5.00	3,700.00	28	3.0 0	227.0 9	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0913	芒果超媒	2021- 09-08	166,4 26.00	3,700.00	28	2.9 0	402.1 9	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0915	阳光电源	2021- 09-08	505,8 27.00	3,700.00	28	3.1 0	1,306 .72	-	-
中信 证券	2021 0908 0000 0917	泰格医药	2021- 09-08	262,8 00.00	1,800.00	28	3.0 0	657.0 0	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1449	澜起科技	2021- 09-08	769,5 60.00	13,200.00	28	3.0 0	1,923 .90	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1451	华大基因	2021- 09-08	527,3 40.00	5,500.00	28	3.1 0	1,362 .30	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1453	沪硅产业	2021- 09-08	366,0 00.00	12,200.00	28	3.3 0	1,006 .50	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1455	中国通号	2021- 09-08	108,1 08.00	19,800.00	28	2.9 0	261.2 6	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1457	英科医疗	2021- 09-08	534,0 06.00	5,400.00	28	3.2 0	1,424 .01	-	-
中信	2021	亿联网络	2021-	108,1	1,300.00	28	2.9	261.3	-	-

证券	0908 0001 1459	络	09-08	34.00			0	2		
中信 证券	2021 0908 0001 1461	爱尔眼 科	2021- 09-08	569,0 87.00	12,700.00	28	3.0 0	1,422 .72	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1463	阳光电 源	2021- 09-08	943,2 99.00	6,900.00	28	2.9 0	2,279 .64	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1465	乐普医 疗	2021- 09-08	521,5 32.00	19,800.00	28	2.9 0	1,260 .36	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1467	亿纬锂 能	2021- 09-08	1,971 ,882. 00	19,800.00	28	3.1 0	5,094 .03	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1469	智飞生 物	2021- 09-08	607,6 20.00	3,800.00	28	2.6 0	1,316 .51	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1471	康泰生 物	2021- 09-08	221,4 07.00	1,900.00	28	3.2 0	590.4 2	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1473	蓝思科 技	2021- 09-08	175,9 80.00	7,000.00	28	3.0 0	439.9 5	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1475	先导智 能	2021- 09-08	302,5 00.00	4,400.00	28	3.0 0	756.2 5	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1477	贝达药 业	2021- 09-08	93,84 1.00	1,100.00	28	3.2 0	250.2 4	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1479	欧普康 视	2021- 09-08	159,5 28.00	2,400.00	28	2.6 0	345.6 4	-	-
中信 证券	2021 0908	同花顺	2021- 09-08	137,3 10.00	1,000.00	28	3.2 0	366.1 6	-	-

	0001 1481									
中信 证券	2021 0908 0001 1483	东方财 富	2021- 09-08	1,475 ,122. 00	41,800.00	28	3.2 0	3,933 .65	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1485	温氏股 份	2021- 09-08	284,6 58.00	20,900.00	28	3.3 0	782.8 1	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1487	汇川技 术	2021- 09-08	511,0 00.00	7,300.00	28	2.6 0	1,107 .17	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1535	三环集 团	2021- 09-08	191,0 97.00	5,100.00	28	2.5 0	398.1 2	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1537	信维通 信	2021- 09-08	324,0 60.00	13,200.00	28	2.8 0	756.1 4	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1539	泰格医 药	2021- 09-08	365,0 00.00	2,500.00	28	2.5 0	760.4 1	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1541	芒果超 媒	2021- 09-08	593,7 36.00	13,200.00	28	3.0 0	1,484 .34	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1543	健帆生 物	2021- 09-08	95,45 6.00	1,900.00	28	3.2 0	254.5 5	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1545	沃森生 物	2021- 09-08	564,2 90.00	7,300.00	28	2.8 0	1,316 .68	-	-
中信 证券	2021 0908 0001 1547	宋城演 艺	2021- 09-08	118,7 70.00	7,400.00	28	3.1 0	306.8 2	-	-
中信 证券	2021 0909 0001	亿联网 络	2021- 09-09	105,9 50.00	1,300.00	28	2.9 0	247.5 1	-	-

	4099									
中信 证券	2021 0909 0001 4101	欧普康 视	2021- 09-09	159,4 80.00	2,400.00	28	2.6 0	334.0 2	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4103	康泰生 物	2021- 09-09	239,4 76.00	1,900.00	28	3.2 0	617.3 2	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4105	三环集 团	2021- 09-09	188,7 00.00	5,100.00	28	2.5 0	380.0 2	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4107	东方财 富	2021- 09-09	1,473 ,868. 00	41,800.00	28	3.2 0	3,799 .30	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4109	智飞生 物	2021- 09-09	606,2 90.00	3,800.00	28	2.6 0	1,269 .84	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4111	同花顺	2021- 09-09	137,5 20.00	1,000.00	28	3.2 0	354.4 9	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4113	爱尔眼 科	2021- 09-09	6,777 ,000. 00	150,000.0 0	28	3.0 0	16,37 7.75	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4115	爱尔眼 科	2021- 09-09	573,7 86.00	12,700.00	28	3.0 0	1,386 .65	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4117	汇川技 术	2021- 09-09	512,3 14.00	7,300.00	28	2.6 0	1,073 .01	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4119	阳光电 源	2021- 09-09	953,3 04.00	6,900.00	28	2.9 0	2,227 .02	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 4121	泰格医 药	2021- 09-09	375,0 00.00	2,500.00	28	2.5 0	755.2 1	-	-

中信 证券	2021 0909 0001 4123	宋城演 艺	2021- 09-09	118,1 78.00	7,400.00	28	3.1 0	295.1 2	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5299	沪硅产 业	2021- 09-09	356,6 06.00	12,200.00	28	3.3 0	947.9 8	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5301	中国通 号	2021- 09-09	109,8 90.00	19,800.00	28	2.9 0	256.7 1	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5303	澜起科 技	2021- 09-09	753,3 24.00	13,200.00	28	3.0 0	1,820 .54	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5315	乐普医 疗	2021- 09-09	525,4 92.00	19,800.00	28	2.9 0	1,227 .61	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5317	亿纬锂 能	2021- 09-09	2,013 ,858. 00	19,800.00	28	3.1 0	5,029 .06	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5319	温氏股 份	2021- 09-09	285,9 12.00	20,900.00	28	3.3 0	760.0 5	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5321	健帆生 物	2021- 09-09	94,71 5.00	1,900.00	28	3.2 0	244.1 6	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5323	先导智 能	2021- 09-09	304,4 80.00	4,400.00	28	3.0 0	735.8 2	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5325	芒果超 媒	2021- 09-09	569,7 12.00	13,200.00	28	3.0 0	1,376 .81	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5327	蓝思科 技	2021- 09-09	172,7 60.00	7,000.00	28	3.0 0	417.5 1	-	-
中信	2021	贝达药	2021-	94,84	1,100.00	28	3.2	244.4	-	-

证券	0909 0001 5329	业	09-09	2.00			0	8		
中信 证券	2021 0909 0001 5331	华大基 因	2021- 09-09	517,2 20.00	5,500.00	28	3.1 0	1,291 .61	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5333	英科医 疗	2021- 09-09	524,2 86.00	5,400.00	28	3.2 0	1,351 .49	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5335	信维通 信	2021- 09-09	316,5 36.00	13,200.00	28	2.8 0	713.9 7	-	-
中信 证券	2021 0909 0001 5337	沃森生 物	2021- 09-09	542,7 55.00	7,300.00	28	2.8 0	1,224 .21	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4836	同花顺	2021- 09-14	899,1 18.00	6,600.00	28	2.9 0	2,028 .01	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4838	亿联网 络	2021- 09-14	527,2 74.00	6,600.00	28	2.6 0	1,066 .27	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4840	康泰生 物	2021- 09-14	745,8 66.00	6,600.00	28	2.9 0	1,682 .34	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4842	英科医 疗	2021- 09-14	645,6 12.00	6,600.00	28	3.1 0	1,556 .64	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4844	华大基 因	2021- 09-14	634,8 54.00	6,600.00	28	2.3 0	1,135 .68	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4846	宋城演 艺	2021- 09-14	393,0 96.00	26,400.00	28	3.7 0	1,131 .24	-	-
中信 证券	2021 0914	沃森生 物	2021- 09-14	1,882 ,848.	26,400.00	28	2.5 0	3,661 .09	-	-

	0001 4848			00						
中信 证券	2021 0914 0001 4850	泰格医 药	2021- 09-14	1,036 ,200. 00	6,600.00	28	3.0 0	2,417 .80	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4852	阳光电 源	2021- 09-14	1,785 ,828. 00	13,200.00	28	3.1 0	4,305 .83	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4854	东方财 富	2021- 09-14	4,439 ,160. 00	125,400.0 0	28	2.9 0	10,01 2.77	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4856	信维通 信	2021- 09-14	312,5 76.00	13,200.00	28	3.0 0	729.3 4	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4858	智飞生 物	2021- 09-14	2,082 ,960. 00	13,200.00	28	2.2 0	3,564 .18	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4860	汇川技 术	2021- 09-14	1,349 ,370. 00	19,800.00	28	2.7 0	2,833 .68	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4862	健帆生 物	2021- 09-14	327,4 92.00	6,600.00	28	3.2 0	815.0 9	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4864	欧普康 视	2021- 09-14	454,0 80.00	6,600.00	28	2.7 0	953.5 7	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4866	温氏股 份	2021- 09-14	870,5 40.00	66,000.00	28	3.2 0	2,166 .68	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4868	贝达药 业	2021- 09-14	574,2 00.00	6,600.00	28	2.6 0	1,161 .16	-	-
中信 证券	2021 0914 0001	芒果超 媒	2021- 09-14	568,5 24.00	13,200.00	28	2.9 0	1,282 .34	-	-

	4870									
中信 证券	2021 0914 0001 4872	三环集 团	2021- 09-14	484,4 40.00	13,200.00	28	2.8 0	1,055 .00	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4874	先导智 能	2021- 09-14	946,5 72.00	13,200.00	28	3.1 0	2,282 .29	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 4876	蓝思科 技	2021- 09-14	474,8 04.00	19,800.00	28	1.8 0	664.7 3	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 5886	澜起科 技	2021- 09-14	754,1 16.00	13,200.00	28	2.3 0	1,349 .03	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 5888	中国通 号	2021- 09-14	209,4 84.00	39,600.00	28	1.9 0	309.5 7	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 5890	沪硅产 业	2021- 09-14	370,9 20.00	13,200.00	28	3.1 0	894.3 3	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 5892	爱尔眼 科	2021- 09-14	1,857 ,240. 00	39,600.00	28	2.7 0	3,900 .20	-	-
中信 证券	2021 0914 0001 5894	乐普医 疗	2021- 09-14	519,1 56.00	19,800.00	28	2.3 0	928.7 1	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9209	健帆生 物	2021- 09-17	369,9 96.00	6,600.00	28	3.2 0	920.8 8	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9211	贝达药 业	2021- 09-17	620,3 34.00	6,600.00	28	2.6 0	1,254 .45	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9213	欧普康 视	2021- 09-17	532,6 20.00	6,600.00	28	2.7 0	1,118 .50	-	-

中信 证券	2021 0917 0000 9215	蓝思科 技	2021- 09-17	440,1 54.00	19,800.00	28	1.8 0	616.2 2	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9217	先导智 能	2021- 09-17	954,4 92.00	13,200.00	28	3.1 0	2,301 .39	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9219	温氏股 份	2021- 09-17	902,8 80.00	66,000.00	28	3.2 0	2,247 .17	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9221	英科医 疗	2021- 09-17	606,9 36.00	6,600.00	28	3.1 0	1,463 .39	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9223	康泰生 物	2021- 09-17	743,4 90.00	6,600.00	28	2.9 0	1,676 .98	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9225	亿联网 络	2021- 09-17	522,3 90.00	6,600.00	28	2.6 0	1,056 .39	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9227	华大基 因	2021- 09-17	606,9 36.00	6,600.00	28	2.3 0	1,085 .74	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9229	智飞生 物	2021- 09-17	2,097 ,876. 00	13,200.00	28	2.2 0	3,589 .70	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9231	汇川技 术	2021- 09-17	1,298 ,484. 00	19,800.00	28	2.7 0	2,726 .82	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9233	信维通 信	2021- 09-17	307,5 60.00	13,200.00	28	3.0 0	717.6 4	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9235	爱尔眼 科	2021- 09-17	2,061 ,576. 00	39,600.00	28	2.7 0	4,329 .31	-	-
中信	2021	同花顺	2021-	882,8	6,600.00	28	2.9	1,991	-	-

证券	0917 0000 9237		09-17	82.00			0	.39		
中信 证券	2021 0917 0000 9239	泰格医 药	2021- 09-17	1,145 ,100. 00	6,600.00	28	3.0 0	2,671 .90	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9241	东方财 富	2021- 09-17	4,351 ,380. 00	125,400.0 0	28	2.9 0	9,814 .78	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9243	三环集 团	2021- 09-17	471,3 72.00	13,200.00	28	2.8 0	1,026 .54	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9245	芒果超 媒	2021- 09-17	558,0 96.00	13,200.00	28	2.9 0	1,258 .82	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9247	沃森生 物	2021- 09-17	1,908 ,192. 00	26,400.00	28	2.5 0	3,710 .37	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9249	宋城演 艺	2021- 09-17	381,4 80.00	26,400.00	28	3.7 0	1,097 .81	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9251	阳光电 源	2021- 09-17	1,636 ,536. 00	13,200.00	28	3.1 0	3,945 .87	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9655	澜起科 技	2021- 09-17	742,5 00.00	13,200.00	28	2.3 0	1,328 .25	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9657	中国通 号	2021- 09-17	209,4 84.00	39,600.00	28	1.9 0	309.5 7	-	-
中信 证券	2021 0917 0000 9659	沪硅产 业	2021- 09-17	373,5 60.00	13,200.00	28	3.1 0	900.6 9	-	-
中信 证券	2021 0917	乐普医 疗	2021- 09-17	502,7 22.00	19,800.00	28	2.3 0	899.3 1	-	-

	0000 9663									
中信 证券	2021 0917 0000 9665	亿纬锂 能	2021- 09-17	1,798 ,434. 00	19,800.00	28	2.6 0	3,636 .83	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1038	先导智 能	2021- 09-22	69,35 0.00	1,000.00	28	3.2 0	172.6 0	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1040	温氏股 份	2021- 09-22	13,29 0.00	1,000.00	28	3.3 0	34.11	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1042	泰格医 药	2021- 09-22	174,7 80.00	1,000.00	28	2.9 0	394.2 3	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1044	健帆生 物	2021- 09-22	53,00 0.00	1,000.00	28	3.1 0	127.7 9	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1046	三环集 团	2021- 09-22	35,88 0.00	1,000.00	28	2.9 0	80.93	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1048	蓝思科 技	2021- 09-22	21,74 0.00	1,000.00	28	3.2 0	54.11	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1050	华大基 因	2021- 09-22	92,15 0.00	1,000.00	28	3.1 0	222.1 8	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1052	英科医 疗	2021- 09-22	89,51 0.00	1,000.00	28	3.3 0	229.7 4	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1054	贝达药 业	2021- 09-22	94,02 0.00	1,000.00	28	2.9 0	212.0 7	-	-
中信 证券	2021 0922 0000	欧普康 视	2021- 09-22	79,80 0.00	1,000.00	28	3.3 0	204.8 2	-	-

	1056									
中信 证券	2021 0922 0000 1058	阳光电 源	2021- 09-22	124,3 50.00	1,000.00	28	3.2 0	309.4 9	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1060	乐普医 疗	2021- 09-22	25,24 0.00	1,000.00	28	3.2 0	62.82	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1062	康泰生 物	2021- 09-22	108,1 10.00	1,000.00	28	3.3 0	277.4 8	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1064	亿纬锂 能	2021- 09-22	89,43 0.00	1,000.00	28	3.0 0	208.6 7	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1066	同花顺	2021- 09-22	131,1 20.00	1,000.00	28	2.4 0	244.7 6	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1068	信维通 信	2021- 09-22	24,31 0.00	1,000.00	28	2.5 0	47.27	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1070	沃森生 物	2021- 09-22	67,75 0.00	1,000.00	28	2.8 0	147.5 4	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1072	宋城演 艺	2021- 09-22	13,96 0.00	1,000.00	28	3.2 0	34.74	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1074	东方财 富	2021- 09-22	34,35 0.00	1,000.00	28	2.9 0	77.48	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1076	智飞生 物	2021- 09-22	160,5 00.00	1,000.00	28	3.7 0	461.8 8	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1078	汇川技 术	2021- 09-22	63,19 0.00	1,000.00	28	3.0 0	147.4 4	-	-

中信 证券	2021 0922 0000 1102	中国通 号	2021- 09-22	5,310 .00	1,000.00	28	2.0 0	8.26	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1104	中微公 司	2021- 09-22	157,7 50.00	1,000.00	28	4.6 0	564.3 9	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1106	沪硅产 业	2021- 09-22	28,09 0.00	1,000.00	28	2.8 0	61.17	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1108	澜起科 技	2021- 09-22	55,08 0.00	1,000.00	28	3.0 0	128.5 2	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1110	石头科 技	2021- 09-22	716,0 60.00	1,000.00	28	1.5 0	835.4 0	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1112	华熙生 物	2021- 09-22	172,5 50.00	1,000.00	28	4.0 0	536.8 2	-	-
中信 证券	2021 0922 0000 1114	华润微	2021- 09-22	349,8 00.00	5,000.00	28	1.0 0	272.0 7	-	-
中信 证券	2021 0922 0003 6447	爱尔眼 科	2021- 09-22	856,3 20.00	16,000.00	28	3.2 0	2,131 .29	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3509	亿纬锂 能	2021- 09-23	13,48 2,000 .00	150,000.0 0	28	2.8 0	29,36 0.80	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3511	沃森生 物	2021- 09-23	679,0 00.00	10,000.00	28	3.3 0	1,742 .77	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3515	温氏股 份	2021- 09-23	136,0 00.00	10,000.00	28	3.3 0	349.0 7	-	-
中信	2021	温氏股	2021-	136,0	10,000.00	28	3.3	349.0	-	-

证券	0923 0001 3517	份	09-23	00.00			0	7		
中信 证券	2021 0923 0001 3525	沪硅产 业	2021- 09-23	380,6 88.00	13,200.00	28	2.4 0	710.6 2	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3533	爱尔眼 科	2021- 09-23	2,073 ,060. 00	39,600.00	28	3.2 0	5,159 .62	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3535	同花顺	2021- 09-23	874,8 30.00	6,600.00	28	3.4 0	2,313 .44	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3537	东方财 富	2021- 09-23	4,304 ,982. 00	125,400.0 0	28	3.0 0	10,04 4.96	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3539	乐普医 疗	2021- 09-23	510,0 48.00	19,800.00	28	2.9 0	1,150 .44	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3541	亿纬锂 能	2021- 09-23	1,779 ,624. 00	19,800.00	28	2.8 0	3,875 .63	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3543	欧普康 视	2021- 09-23	528,0 00.00	6,600.00	28	3.1 0	1,273 .07	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 3545	华大基 因	2021- 09-23	606,7 38.00	6,600.00	28	2.9 0	1,368 .53	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 5547	康泰生 物	2021- 09-23	715,3 74.00	6,600.00	28	3.1 0	1,724 .85	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 5549	亿联网 络	2021- 09-23	520,7 40.00	6,600.00	28	3.2 0	1,296 .06	-	-
中信 证券	2021 0923	宋城演 艺	2021- 09-23	429,9 62.00	29,900.00	28	3.4 0	1,137 .01	-	-

	0001 6879									
中信 证券	2021 0923 0001 6881	澜起科 技	2021- 09-23	738,6 72.00	13,200.00	28	2.8 0	1,608 .66	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6899	中国通 号	2021- 09-23	212,2 56.00	39,600.00	28	2.1 0	346.6 8	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6901	宋城演 艺	2021- 09-23	379,6 32.00	26,400.00	28	3.4 0	1,003 .92	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6903	阳光电 源	2021- 09-23	1,709 ,268. 00	13,200.00	28	2.9 0	3,855 .35	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6905	泰格医 药	2021- 09-23	1,121 ,934. 00	6,600.00	28	3.7 0	3,228 .68	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6907	汇川技 术	2021- 09-23	1,294 ,920. 00	19,800.00	28	3.0 0	3,021 .48	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6909	信维通 信	2021- 09-23	322,4 76.00	13,200.00	28	3.2 0	802.6 1	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6911	沃森生 物	2021- 09-23	1,792 ,560. 00	26,400.00	28	3.3 0	4,600 .90	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6913	三环集 团	2021- 09-23	478,8 96.00	13,200.00	28	3.3 0	1,229 .17	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6915	温氏股 份	2021- 09-23	897,6 00.00	66,000.00	28	3.3 0	2,303 .84	-	-
中信 证券	2021 0923 0001	健帆生 物	2021- 09-23	351,1 20.00	6,600.00	28	3.1 0	846.5 9	-	-

	6917									
中信 证券	2021 0923 0001 6919	贝达药 业	2021- 09-23	620,3 34.00	6,600.00	28	3.3 0	1,592 .19	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6921	芒果超 媒	2021- 09-23	545,2 92.00	13,200.00	28	3.0 0	1,272 .35	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6923	蓝思科 技	2021- 09-23	442,1 34.00	19,800.00	28	3.1 0	1,066 .03	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6925	先导智 能	2021- 09-23	935,0 88.00	13,200.00	28	2.3 0	1,672 .77	-	-
中信 证券	2021 0923 0001 6927	智飞生 物	2021- 09-23	2,113 ,320. 00	13,200.00	28	3.2 0	5,259 .82	-	-
中信 证券	2021 0928 0001 4484	康泰生 物	2021- 09-23	1,980 .00	-	28	3.1 0	-	-	-
中信 证券	2021 0928 0001 4623	康泰生 物	2021- 09-22	300.0 0	-	28	3.3 0	-	-	-
中信 证券	2021 0928 0001 4642	康泰生 物	2021- 09-17	1,980 .00	-	28	2.9 0	-	-	-
中信 证券	2021 0928 0001 4776	康泰生 物	2021- 09-14	1,980 .00	-	28	2.9 0	-	-	-
中信 证券	2021 0928 0001 4798	康泰生 物	2021- 09-09	570.0 0	-	28	3.2 0	-	-	-
中信 证券	2021 0928 0001 4799	康泰生 物	2021- 09-08	540.0 0	-	28	2.9 0	-	-	-

中信 证券	2021 0928 0001 4804	康泰生 物	2021- 09-08	570.0 0	-	28	3.2 0	-	-	-
中信 证券	2021 0928 0001 4810	康泰生 物	2021- 09-07	570.0 0	-	28	3.2 0	-	-	-
中信 证券	2021 0929 0001 9181	中微公 司	2021- 09-29	7,779 ,500. 00	50,000.00	28	3.0 0	18,15 2.17	-	-
中信 证券	2021 0929 0001 9490	英科医 疗	2021- 09-22	-	500.00	28	3.3 0	-	-	-
中信 证券	2021 0929 0001 9513	英科医 疗	2021- 09-17	-	3,300.00	28	3.1 0	-	-	-
中信 证券	2021 0929 0001 9521	英科医 疗	2021- 09-14	-	3,300.00	28	3.1 0	-	-	-
中信 证券	2021 0929 0001 9531	英科医 疗	2021- 09-09	-	2,700.00	28	3.2 0	-	-	-
中信 证券	2021 0929 0001 9537	英科医 疗	2021- 09-08	-	2,700.00	28	3.2 0	-	-	-
中信 证券	2021 0929 0001 9539	英科医 疗	2021- 09-07	-	2,700.00	28	3.2 0	-	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9363	东方财 富	2021- 10-08	1,445 ,862. 00	41,800.00	28	2.9 0	3,261 .22	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9365	同花顺	2021- 10-08	122,1 00.00	1,000.00	28	2.4 0	227.9 2	-	-
中信	2021	欧普康	2021-	193,8	2,400.00	28	3.3	497.4	-	-

证券	1008 0005 9367	视	10-08	24.00			0	8		
中信 证券	2021 1008 0005 9369	三环集 团	2021- 10-08	189,3 12.00	5,100.00	28	2.9 0	427.0 0	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9371	温氏股 份	2021- 10-08	320,3 97.00	20,900.00	28	3.3 0	822.3 5	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9373	汇川技 术	2021- 10-08	468,3 68.00	7,300.00	28	3.0 0	1,092 .86	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9375	贝达药 业	2021- 10-08	106,7 22.00	1,100.00	28	2.9 0	240.7 2	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9377	智飞生 物	2021- 10-08	555,3 32.00	3,800.00	28	3.7 0	1,598 .12	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9379	亿纬锂 能	2021- 10-08	1,993 ,068. 00	19,800.00	28	3.0 0	4,650 .49	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9381	乐普医 疗	2021- 10-08	541,7 28.00	19,800.00	28	3.2 0	1,348 .30	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9383	先导智 能	2021- 10-08	308,4 40.00	4,400.00	28	3.2 0	767.6 7	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9385	蓝思科 技	2021- 10-08	148,4 70.00	7,000.00	28	3.2 0	369.5 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9387	康泰生 物	2021- 10-08	203,0 53.00	1,900.00	28	3.3 0	521.1 7	-	-
中信 证券	2021 1008	信维通 信	2021- 10-08	306,9 00.00	13,200.00	28	2.5 0	596.7 5	-	-

	0005 9389									
中信 证券	2021 1008 0005 9391	泰格医 药	2021- 10-08	433,3 00.00	2,500.00	28	2.9 0	977.3 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9395	阳光电 源	2021- 10-08	1,036 ,380. 00	6,900.00	28	3.2 0	2,579 .43	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9397	华大基 因	2021- 10-08	479,1 05.00	5,500.00	28	3.1 0	1,155 .18	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9399	澜起科 技	2021- 10-08	790,8 12.00	13,200.00	28	3.0 0	1,845 .23	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9401	英科医 疗	2021- 10-08	309,5 28.00	5,400.00	28	3.3 0	794.4 6	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9403	亿联网 络	2021- 10-08	109,7 07.00	1,300.00	28	2.3 0	196.2 5	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9405	爱尔眼 科	2021- 10-08	675,3 86.00	12,700.00	28	3.3 0	1,733 .49	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9407	中国通 号	2021- 10-08	103,3 56.00	19,800.00	28	2.0 0	160.7 8	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9409	健帆生 物	2021- 10-08	111,3 40.00	1,900.00	28	3.1 0	268.4 5	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9411	宋城演 艺	2021- 10-08	110,0 38.00	7,400.00	28	3.2 0	273.8 7	-	-
中信 证券	2021 1008 0005	沃森生 物	2021- 10-08	435,5 18.00	7,300.00	28	2.8 0	948.4 6	-	-

	9413									
中信 证券	2021 1008 0005 9415	芒果超 媒	2021- 10-08	627,7 92.00	13,200.00	28	3.0 0	1,464 .85	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9417	沪硅产 业	2021- 10-08	354,0 44.00	12,200.00	28	2.8 0	771.0 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0005 9419	智飞生 物	2021- 10-08	555,3 32.00	3,800.00	28	3.7 0	1,598 .12	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0033	泰格医 药	2021- 10-08	433,3 00.00	2,500.00	28	2.9 0	977.3 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0035	汇川技 术	2021- 10-08	468,3 68.00	7,300.00	28	3.0 0	1,092 .86	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0037	澜起科 技	2021- 10-08	790,8 12.00	13,200.00	28	3.0 0	1,845 .23	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0039	东方财 富	2021- 10-08	1,445 ,862. 00	41,800.00	28	2.9 0	3,261 .22	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0041	英科医 疗	2021- 10-08	309,5 28.00	5,400.00	28	3.3 0	794.4 6	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0043	华大基 因	2021- 10-08	479,1 05.00	5,500.00	28	3.1 0	1,155 .18	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0045	同花顺	2021- 10-08	122,1 00.00	1,000.00	28	2.4 0	227.9 2	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0047	沃森生 物	2021- 10-08	435,5 18.00	7,300.00	28	2.8 0	948.4 6	-	-

中信 证券	2021 1008 0006 0049	宋城演 艺	2021- 10-08	110,0 38.00	7,400.00	28	3.2 0	273.8 7	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0051	贝达药 业	2021- 10-08	106,7 22.00	1,100.00	28	2.9 0	240.7 2	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0053	信维通 信	2021- 10-08	306,9 00.00	13,200.00	28	2.5 0	596.7 5	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0055	三环集 团	2021- 10-08	189,3 12.00	5,100.00	28	2.9 0	427.0 0	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0057	健帆生 物	2021- 10-08	111,3 40.00	1,900.00	28	3.1 0	268.4 5	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0059	欧普康 视	2021- 10-08	193,8 24.00	2,400.00	28	3.3 0	497.4 8	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0061	蓝思科 技	2021- 10-08	148,4 70.00	7,000.00	28	3.2 0	369.5 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0063	阳光电 源	2021- 10-08	1,036 ,380. 00	6,900.00	28	3.2 0	2,579 .43	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0065	亿纬锂 能	2021- 10-08	1,993 ,068. 00	19,800.00	28	3.0 0	4,650 .49	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0067	沪硅产 业	2021- 10-08	354,0 44.00	12,200.00	28	2.8 0	771.0 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 0069	亿联网 络	2021- 10-08	109,7 07.00	1,300.00	28	2.3 0	196.2 5	-	-
中信	2021	乐普医	2021-	541,7	19,800.00	28	3.2	1,348	-	-

证券	1008 0006 0071	疗	10-08	28.00			0	.30		
中信 证券	2021 1008 0006 0073	康泰生 物	2021- 10-08	203,0 53.00	1,900.00	28	3.3 0	521.1 7	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4527	中国通 号	2021- 10-08	103,3 56.00	19,800.00	28	2.0 0	160.7 8	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4529	温氏股 份	2021- 10-08	320,3 97.00	20,900.00	28	3.3 0	822.3 5	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4531	先导智 能	2021- 10-08	308,4 40.00	4,400.00	28	3.2 0	767.6 7	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4533	芒果超 媒	2021- 10-08	627,7 92.00	13,200.00	28	3.0 0	1,464 .85	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4535	爱尔眼 科	2021- 10-08	675,3 86.00	12,700.00	28	3.3 0	1,733 .49	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4611	东方财 富	2021- 10-08	1,445 ,862. 00	41,800.00	28	3.0 0	3,373 .68	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4613	阳光电 源	2021- 10-08	1,036 ,380. 00	6,900.00	28	3.0 0	2,418 .22	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4615	宋城演 艺	2021- 10-08	110,0 38.00	7,400.00	28	3.3 0	282.4 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4617	泰格医 药	2021- 10-08	433,3 00.00	2,500.00	28	1.8 0	606.6 2	-	-
中信 证券	2021 1008	英科医 疗	2021- 10-08	309,5 28.00	5,400.00	28	3.1 0	746.3 1	-	-

	0006 4619									
中信 证券	2021 1008 0006 4621	信维通 信	2021- 10-08	306,9 00.00	13,200.00	28	2.9 0	692.2 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4623	沃森生 物	2021- 10-08	435,5 18.00	7,300.00	28	1.9 0	643.6 0	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4625	汇川技 术	2021- 10-08	468,3 68.00	7,300.00	28	2.9 0	1,056 .43	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4627	亿联网 络	2021- 10-08	109,7 07.00	1,300.00	28	2.7 0	230.3 8	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4629	欧普康 视	2021- 10-08	193,8 24.00	2,400.00	28	2.4 0	361.8 0	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4631	中国通 号	2021- 10-08	103,3 56.00	19,800.00	28	2.2 0	176.8 5	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4633	华大基 因	2021- 10-08	479,1 05.00	5,500.00	28	3.2 0	1,192 .44	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4635	康泰生 物	2021- 10-08	203,0 53.00	1,900.00	28	3.1 0	489.5 8	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4637	同花顺	2021- 10-08	122,1 00.00	1,000.00	28	3.0 0	284.9 0	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4639	温氏股 份	2021- 10-08	320,3 97.00	20,900.00	28	3.2 0	797.4 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0006	健帆生 物	2021- 10-08	111,3 40.00	1,900.00	28	3.1 0	268.4 5	-	-

	4641									
中信 证券	2021 1008 0006 4643	蓝思科 技	2021- 10-08	148,4 70.00	7,000.00	28	3.0 0	346.4 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4645	澜起科 技	2021- 10-08	790,8 12.00	13,200.00	28	2.9 0	1,783 .72	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4647	沪硅产 业	2021- 10-08	354,0 44.00	12,200.00	28	4.4 0	1,211 .62	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4649	贝达药 业	2021- 10-08	106,7 22.00	1,100.00	28	2.5 0	207.5 2	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4651	亿纬锂 能	2021- 10-08	1,993 ,068. 00	19,800.00	28	3.0 0	4,650 .49	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 4653	乐普医 疗	2021- 10-08	541,7 28.00	19,800.00	28	2.9 0	1,221 .90	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 5387	爱尔眼 科	2021- 10-08	675,3 86.00	12,700.00	28	2.8 0	1,470 .84	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 5389	三环集 团	2021- 10-08	189,3 12.00	5,100.00	28	2.4 0	353.3 8	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 5391	智飞生 物	2021- 10-08	555,3 32.00	3,800.00	28	2.0 0	863.8 5	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 5393	先导智 能	2021- 10-08	308,4 40.00	4,400.00	28	3.1 0	743.6 8	-	-
中信 证券	2021 1008 0006 5395	芒果超 媒	2021- 10-08	627,7 92.00	13,200.00	28	2.2 0	1,074 .22	-	-

中信 证券	2021 1008 0007 0057	三环集 团	2021- 10-08	137,3 44.00	3,700.00	28	2.9 0	309.7 9	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0059	芒果超 媒	2021- 10-08	175,9 72.00	3,700.00	28	3.0 0	410.6 0	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0061	信维通 信	2021- 10-08	86,02 5.00	3,700.00	28	2.5 0	167.2 7	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0063	阳光电 源	2021- 10-08	555,7 40.00	3,700.00	28	3.2 0	1,383 .18	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0065	泰格医 药	2021- 10-08	311,9 76.00	1,800.00	28	2.9 0	703.6 8	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0067	沃森生 物	2021- 10-08	435,5 18.00	7,300.00	28	2.8 0	948.4 6	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0069	澜起科 技	2021- 10-08	221,6 67.00	3,700.00	28	3.0 0	517.2 2	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0071	宋城演 艺	2021- 10-08	108,5 51.00	7,300.00	28	3.2 0	270.1 7	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0073	沪硅产 业	2021- 10-08	107,3 74.00	3,700.00	28	2.8 0	233.8 4	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0075	欧普康 视	2021- 10-08	145,3 68.00	1,800.00	28	3.3 0	373.1 1	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0077	亿联网 络	2021- 10-08	151,9 02.00	1,800.00	28	2.3 0	271.7 4	-	-
中信	2021	中国通	2021-	57,42	11,000.00	28	2.0	89.32	-	-

证券	1008 0007 0079	号	10-08	0.00			0			
中信 证券	2021 1008 0007 0081	乐普医 疗	2021- 10-08	150,4 80.00	5,500.00	28	3.2 0	374.5 3	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0083	汇川技 术	2021- 10-08	352,8 80.00	5,500.00	28	3.0 0	823.3 9	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0085	亿纬锂 能	2021- 10-08	553,6 30.00	5,500.00	28	3.0 0	1,291 .80	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0087	华大基 因	2021- 10-08	156,7 98.00	1,800.00	28	3.1 0	378.0 6	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0089	东方财 富	2021- 10-08	864,7 50.00	25,000.00	28	2.9 0	1,950 .49	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0091	先导智 能	2021- 10-08	259,3 70.00	3,700.00	28	3.2 0	645.5 4	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0093	健帆生 物	2021- 10-08	105,4 80.00	1,800.00	28	3.1 0	254.3 2	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0095	贝达药 业	2021- 10-08	174,6 36.00	1,800.00	28	2.9 0	393.9 0	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0097	康泰生 物	2021- 10-08	192,3 66.00	1,800.00	28	3.3 0	493.7 4	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0099	温氏股 份	2021- 10-08	280,5 39.00	18,300.00	28	3.3 0	720.0 5	-	-
中信 证券	2021 1008	爱尔眼 科	2021- 10-08	584,9 80.00	11,000.00	28	3.3 0	1,501 .45	-	-

	0007 0101									
中信 证券	2021 1008 0007 0103	智飞生 物	2021- 10-08	540,7 18.00	3,700.00	28	3.7 0	1,556 .07	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0105	蓝思科 技	2021- 10-08	116,6 55.00	5,500.00	28	3.2 0	290.3 4	-	-
中信 证券	2021 1008 0007 0107	同花顺	2021- 10-08	219,7 80.00	1,800.00	28	2.4 0	410.2 6	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 5095	智飞生 物	2021- 10-12	1,848 ,000. 00	13,200.00	28	2.0 0	2,874 .67	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 5099	爱尔眼 科	2021- 10-12	2,035 ,440. 00	39,600.00	28	2.8 0	4,432 .74	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 5101	同花顺	2021- 10-12	775,3 68.00	6,600.00	28	3.0 0	1,809 .19	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 5103	东方财 富	2021- 10-12	4,110 ,612. 00	125,400.0 0	28	3.0 0	9,591 .43	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 5105	乐普医 疗	2021- 10-12	540,5 40.00	19,800.00	28	2.9 0	1,219 .22	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7057	澜起科 技	2021- 10-12	781,5 72.00	13,200.00	28	2.9 0	1,762 .88	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7059	中国通 号	2021- 10-12	205,1 28.00	39,600.00	28	2.2 0	351.0 0	-	-
中信 证券	2021 1012 0001	沪硅产 业	2021- 10-12	360,8 88.00	13,200.00	28	4.4 0	1,235 .04	-	-

	7063									
中信 证券	2021 1012 0001 7069	贝达药 业	2021- 10-12	632,2 14.00	6,600.00	28	2.5 0	1,229 .31	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7073	欧普康 视	2021- 10-12	516,1 86.00	6,600.00	28	2.4 0	963.5 5	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7075	康泰生 物	2021- 10-12	690,5 58.00	6,600.00	28	3.1 0	1,665 .01	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7077	温氏股 份	2021- 10-12	1,005 ,180. 00	66,000.00	28	3.2 0	2,501 .78	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7079	健帆生 物	2021- 10-12	378,1 80.00	6,600.00	28	3.1 0	911.8 3	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7081	英科医 疗	2021- 10-12	413,9 52.00	6,600.00	28	3.1 0	998.0 8	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7085	亿联网 络	2021- 10-12	545,8 20.00	6,600.00	28	2.7 0	1,146 .22	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7087	华大基 因	2021- 10-12	576,6 42.00	6,600.00	28	3.2 0	1,435 .20	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7093	宋城演 艺	2021- 10-12	380,4 24.00	26,400.00	28	3.3 0	976.4 2	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7095	阳光电 源	2021- 10-12	1,894 ,200. 00	13,200.00	28	3.0 0	4,419 .80	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7097	汇川技 术	2021- 10-12	1,178 ,298. 00	19,800.00	28	2.9 0	2,657 .72	-	-

中信 证券	2021 1012 0001 7099	信维通 信	2021- 10-12	305,0 52.00	13,200.00	28	2.9 0	688.0 6	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7101	沃森生 物	2021- 10-12	1,494 ,240. 00	26,400.00	28	1.9 0	2,208 .15	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7103	芒果超 媒	2021- 10-12	517,1 76.00	13,200.00	28	2.2 0	884.9 5	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7107	蓝思科 技	2021- 10-12	411,0 48.00	19,800.00	28	3.0 0	959.1 1	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7109	先导智 能	2021- 10-12	912,1 20.00	13,200.00	28	3.1 0	2,199 .22	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7111	泰格医 药	2021- 10-12	1,095 ,270. 00	6,600.00	28	1.8 0	1,533 .38	-	-
中信 证券	2021 1012 0001 7113	三环集 团	2021- 10-12	494,6 04.00	13,200.00	28	2.4 0	923.2 6	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3643	沪硅产 业	2021- 10-15	377,6 52.00	13,200.00	28	5.2 0	1,527 .39	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3645	澜起科 技	2021- 10-15	774,7 08.00	13,200.00	28	2.7 0	1,626 .89	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3647	中国通 号	2021- 10-15	202,7 52.00	39,600.00	28	2.8 0	441.5 5	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3649	三环集 团	2021- 10-15	515,8 56.00	13,200.00	28	3.0 0	1,203 .66	-	-
中信	2021	芒果超	2021-	522,5	13,200.00	28	2.5	1,016	-	-

证券	1015 0000 3651	媒	10-15	88.00			0	.14		
中信 证券	2021 1015 0000 3653	信维通 信	2021- 10-15	295,1 52.00	13,200.00	28	3.3 0	757.5 6	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3655	贝达药 业	2021- 10-15	597,9 60.00	6,600.00	28	3.4 0	1,581 .27	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3657	先导智 能	2021- 10-15	1,008 ,480. 00	13,200.00	28	2.0 0	1,568 .75	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3659	温氏股 份	2021- 10-15	956,3 40.00	66,000.00	28	3.3 0	2,454 .61	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3661	健帆生 物	2021- 10-15	360,9 54.00	6,600.00	28	3.4 0	954.5 2	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3663	泰格医 药	2021- 10-15	1,100 ,220. 00	6,600.00	28	2.8 0	2,396 .03	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3665	阳光电 源	2021- 10-15	2,080 ,056. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,368 .12	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3667	欧普康 视	2021- 10-15	430,5 18.00	6,600.00	28	3.7 0	1,238 .94	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3669	东方财 富	2021- 10-15	4,247 ,298. 00	125,400.0 0	28	2.8 0	9,249 .67	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3671	康泰生 物	2021- 10-15	706,5 30.00	6,600.00	28	3.0 0	1,648 .57	-	-
中信 证券	2021 1015	亿联网 络	2021- 10-15	540,2 10.00	6,600.00	28	3.0 0	1,260 .49	-	-

	0000 3673									
中信 证券	2021 1015 0000 3675	智飞生 物	2021- 10-15	1,935 ,384. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,064 .31	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3677	乐普医 疗	2021- 10-15	522,1 26.00	19,800.00	28	3.7 0	1,502 .56	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3679	汇川技 术	2021- 10-15	1,244 ,430. 00	19,800.00	28	2.6 0	2,516 .51	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3681	沃森生 物	2021- 10-15	1,531 ,992. 00	26,400.00	28	2.5 0	2,978 .87	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3683	同花顺	2021- 10-15	766,9 20.00	6,600.00	28	3.2 0	1,908 .78	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3685	亿纬锂 能	2021- 10-15	2,141 ,370. 00	19,800.00	28	2.7 0	4,496 .88	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3687	宋城演 艺	2021- 10-15	408,4 08.00	26,400.00	28	3.7 0	1,175 .31	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3689	爱尔眼 科	2021- 10-15	1,865 ,952. 00	39,600.00	28	3.1 0	4,499 .02	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3691	蓝思科 技	2021- 10-15	409,2 66.00	19,800.00	28	3.4 0	1,082 .28	-	-
中信 证券	2021 1015 0000 3693	华大基 因	2021- 10-15	562,4 52.00	6,600.00	28	5.0 0	2,187 .31	-	-
中信 证券	2021 1015 0000	英科医 疗	2021- 10-15	395,8 02.00	6,600.00	28	3.3 0	1,015 .89	-	-

	3695									
中信 证券	2021 1019 0000 0977	温氏股 份	2021- 10-19	32,76 0.00	2,000.00	14	3.4 0	43.32	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5259	华润微	2021- 10-20	342,1 00.00	5,000.00	28	1.6 0	425.7 2	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5261	欧普康 视	2021- 10-20	65,75 0.00	1,000.00	28	3.7 0	189.2 1	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5263	先导智 能	2021- 10-20	75,00 0.00	1,000.00	28	2.0 0	116.6 7	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5265	华熙生 物	2021- 10-20	174,0 50.00	1,000.00	28	4.4 0	595.6 4	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5267	澜起科 技	2021- 10-20	55,90 0.00	1,000.00	28	2.7 0	117.3 9	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5269	石头科 技	2021- 10-20	844,1 00.00	1,000.00	28	2.9 0	1,903 .91	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5271	健帆生 物	2021- 10-20	52,67 0.00	1,000.00	28	3.4 0	139.2 8	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5273	温氏股 份	2021- 10-20	16,34 0.00	1,000.00	28	3.3 0	41.94	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5275	蓝思科 技	2021- 10-20	20,08 0.00	1,000.00	28	3.4 0	53.10	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5277	三环集 团	2021- 10-20	38,92 0.00	1,000.00	28	3.0 0	90.81	-	-

中信 证券	2021 1020 0000 5279	华大基 因	2021- 10-20	84,69 0.00	1,000.00	28	5.0 0	329.3 5	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5281	泰格医 药	2021- 10-20	166,7 00.00	1,000.00	28	2.8 0	363.0 4	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5283	英科医 疗	2021- 10-20	53,45 0.00	1,000.00	28	3.3 0	137.1 9	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5285	爱尔眼 科	2021- 10-20	748,9 60.00	16,000.00	28	3.1 0	1,805 .83	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5295	中国通 号	2021- 10-20	5,120 .00	1,000.00	28	2.8 0	11.15	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5297	中微公 司	2021- 10-20	149,8 50.00	1,000.00	28	2.3 0	268.0 7	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5299	汇川技 术	2021- 10-20	62,16 0.00	1,000.00	28	2.6 0	125.7 0	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5301	乐普医 疗	2021- 10-20	25,90 0.00	1,000.00	28	3.7 0	74.53	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5303	阳光电 源	2021- 10-20	160,4 00.00	1,000.00	28	2.7 0	336.8 4	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5305	康泰生 物	2021- 10-20	107,0 60.00	1,000.00	28	3.0 0	249.8 1	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5307	沪硅产 业	2021- 10-20	27,42 0.00	1,000.00	28	5.2 0	110.9 0	-	-
中信	2021	亿纬锂	2021-	114,0	1,000.00	28	2.7	239.4	-	-

证券	1020 0000 5309	能	10-20	20.00			0	4		
中信 证券	2021 1020 0000 5311	智飞生 物	2021- 10-20	145,8 50.00	1,000.00	28	2.7 0	306.2 9	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5313	贝达药 业	2021- 10-20	85,27 0.00	1,000.00	28	3.4 0	225.4 9	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5315	宋城演 艺	2021- 10-20	13,86 0.00	1,000.00	28	3.7 0	39.89	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5317	信维通 信	2021- 10-20	21,33 0.00	1,000.00	28	3.3 0	54.75	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5319	沃森生 物	2021- 10-20	59,66 0.00	1,000.00	28	2.5 0	116.0 1	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5321	东方财 富	2021- 10-20	33,46 0.00	1,000.00	28	2.8 0	72.87	-	-
中信 证券	2021 1020 0000 5323	同花顺	2021- 10-20	117,1 20.00	1,000.00	28	3.2 0	291.5 0	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4908	温氏股 份	2021- 10-21	1,044 ,780. 00	66,000.00	28	3.3 0	2,681 .60	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4914	沪硅产 业	2021- 10-21	357,7 20.00	13,200.00	28	5.2 0	1,446 .78	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4916	中国通 号	2021- 10-21	202,7 52.00	39,600.00	28	2.8 0	441.5 5	-	-
中信 证券	2021 1021	泰格医 药	2021- 10-21	1,097 ,778.	6,600.00	28	2.8 0	2,390 .72	-	-

	0000 4926			00						
中信 证券	2021 1021 0000 4928	阳光电 源	2021- 10-21	2,110 ,416. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,431 .87	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4930	沃森生 物	2021- 10-21	596,0 00.00	10,000.00	28	2.5 0	1,158 .89	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4932	芒果超 媒	2021- 10-21	517,1 76.00	13,200.00	28	2.5 0	1,005 .62	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4934	宋城演 艺	2021- 10-21	373,5 60.00	26,400.00	28	3.7 0	1,075 .02	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4936	三环集 团	2021- 10-21	527,8 68.00	13,200.00	28	3.0 0	1,231 .69	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4938	宋城演 艺	2021- 10-21	423,0 85.00	29,900.00	28	3.7 0	1,217 .54	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4940	康泰生 物	2021- 10-21	734,9 10.00	6,600.00	28	3.0 0	1,714 .79	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4942	沃森生 物	2021- 10-21	1,573 ,440. 00	26,400.00	28	2.5 0	3,059 .47	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4944	蓝思科 技	2021- 10-21	385,7 04.00	19,800.00	28	3.4 0	1,019 .97	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4946	澜起科 技	2021- 10-21	731,2 80.00	13,200.00	28	2.7 0	1,535 .69	-	-
中信 证券	2021 1021 0000	健帆生 物	2021- 10-21	348,7 44.00	6,600.00	28	3.4 0	922.2 3	-	-

	4948									
中信 证券	2021 1021 0000 4950	亿联网 络	2021- 10-21	513,5 46.00	6,600.00	28	3.0 0	1,198 .27	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4952	华大基 因	2021- 10-21	554,5 32.00	6,600.00	28	5.0 0	2,156 .51	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4954	先导智 能	2021- 10-21	995,2 80.00	13,200.00	28	2.0 0	1,548 .21	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4956	欧普康 视	2021- 10-21	449,3 94.00	6,600.00	28	3.7 0	1,293 .26	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4958	贝达药 业	2021- 10-21	548,0 64.00	6,600.00	28	3.4 0	1,449 .32	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4960	信维通 信	2021- 10-21	279,1 80.00	13,200.00	28	3.3 0	716.5 6	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4970	东方财 富	2021- 10-21	4,209 ,678. 00	125,400.0 0	28	2.8 0	9,167 .74	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4972	智飞生 物	2021- 10-21	1,931 ,028. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,055 .16	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4974	汇川技 术	2021- 10-21	1,212 ,948. 00	19,800.00	28	2.6 0	2,452 .85	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4976	同花顺	2021- 10-21	769,5 60.00	6,600.00	28	3.2 0	1,915 .35	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4978	亿纬锂 能	2021- 10-21	16,93 2,000 .00	150,000.0 0	28	2.7 0	35,55 7.20	-	-

中信 证券	2021 1021 0000 4980	乐普医 疗	2021- 10-21	511,2 36.00	19,800.00	28	3.7 0	1,471 .22	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4982	爱尔眼 科	2021- 10-21	1,844 ,568. 00	39,600.00	28	3.1 0	4,447 .46	-	-
中信 证券	2021 1021 0000 4984	亿纬锂 能	2021- 10-21	2,235 ,024. 00	19,800.00	28	2.7 0	4,693 .55	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0688	亿纬锂 能	2021- 10-25	1,782 ,450. 00	15,300.00	28	3.2 0	4,436 .32	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0689	乐普医 疗	2021- 10-25	397,1 88.00	15,300.00	28	2.8 0	864.9 9	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0692	信维通 信	2021- 10-25	221,6 56.00	10,300.00	28	3.2 0	551.6 8	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0694	沃森生 物	2021- 10-25	1,219 ,750. 00	20,500.00	28	2.1 0	1,992 .26	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0695	汇川技 术	2021- 10-25	948,6 00.00	15,300.00	28	2.3 0	1,696 .94	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0698	同花顺	2021- 10-25	624,0 00.00	5,200.00	28	3.2 0	1,553 .07	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0700	温氏股 份	2021- 10-25	810,0 64.00	51,400.00	28	2.9 0	1,827 .14	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0701	三环集 团	2021- 10-25	398,3 01.00	10,300.00	28	2.7 0	836.4 3	-	-
中信	2021	阳光电	2021-	1,771	10,300.00	28	2.6	3,582	-	-

证券	1025 0000 0702	源	10-25	,600. 00			0	.57		
中信 证券	2021 1025 0000 0706	健帆生 物	2021- 10-25	280,5 40.00	5,200.00	28	2.5 0	545.4 9	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0708	华大基 因	2021- 10-25	445,6 92.00	5,200.00	28	3.2 0	1,109 .28	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0709	英科医 疗	2021- 10-25	283,5 04.00	5,200.00	28	3.1 0	683.5 6	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0710	贝达药 业	2021- 10-25	439,9 20.00	5,200.00	28	2.3 0	786.9 7	-	-
中信 证券	2021 1025 0000 0816	沪硅产 业	2021- 10-25	287,2 67.00	10,300.00	28	3.6 0	804.3 5	-	-
中信 证券	2021 1027 0001 7039	中微公 司	2021- 10-27	7,529 ,500. 00	50,000.00	28	5.3 0	31,03 8.27	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1016	乐普医 疗	2021- 11-01	170,4 00.00	8,000.00	14	3.0 0	198.8 0	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1018	汇川技 术	2021- 11-01	520,1 60.00	8,000.00	14	3.1 0	627.0 8	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1019	同花顺	2021- 11-01	232,0 00.00	2,000.00	14	3.4 0	306.7 6	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1020	亿纬锂 能	2021- 11-01	873,2 00.00	8,000.00	14	3.1 0	1,052 .69	-	-
中信 证券	2021 1101	健帆生 物	2021- 11-01	102,4 60.00	2,000.00	14	3.3 0	131.4 9	-	-

	0000 1024									
中信 证券	2021 1101 0000 1026	贝达药 业	2021- 11-01	156,9 00.00	2,000.00	14	2.5 0	152.5 4	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1028	英科医 疗	2021- 11-01	103,5 80.00	2,000.00	14	3.4 0	136.9 6	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1030	温氏股 份	2021- 11-01	449,2 80.00	27,000.00	14	3.4 0	594.0 5	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1031	华大基 因	2021- 11-01	178,9 00.00	2,000.00	14	3.4 0	236.5 5	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1032	沃森生 物	2021- 11-01	593,4 50.00	11,000.00	14	2.7 0	623.1 2	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1036	信维通 信	2021- 11-01	123,3 50.00	5,000.00	14	3.4 0	163.1 0	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1037	阳光电 源	2021- 11-01	824,2 50.00	5,000.00	14	2.8 0	897.5 2	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1038	三环集 团	2021- 11-01	203,2 50.00	5,000.00	14	3.2 0	252.9 3	-	-
中信 证券	2021 1101 0000 1042	沪硅产 业	2021- 11-01	139,3 50.00	5,000.00	14	3.5 0	189.6 7	-	-
中信 证券	2021 1102 0000 4214	温氏股 份	2021- 11-02	33,82 0.00	2,000.00	14	3.0 0	39.46	-	-
中信 证券	2021 1104 0000	欧普康 视	2021- 11-04	1,213 ,150. 00	19,000.00	14	3.1 0	1,462 .52	-	-

	0760									
中信 证券	2021 1105 0005 5485	智飞生 物	2021- 11-05	504,7 16.00	3,800.00	28	2.6 0	1,020 .65	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5487	智飞生 物	2021- 11-05	504,7 16.00	3,800.00	28	2.6 0	1,020 .65	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5489	东方财 富	2021- 11-05	1,368 ,114. 00	41,800.00	28	3.3 0	3,511 .49	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5491	智飞生 物	2021- 11-05	504,7 16.00	3,800.00	28	2.6 0	1,020 .65	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5493	华大基 因	2021- 11-05	504,3 50.00	5,500.00	28	3.2 0	1,255 .27	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5495	英科医 疗	2021- 11-05	300,2 40.00	5,400.00	28	3.1 0	723.9 1	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5497	华大基 因	2021- 11-05	165,0 60.00	1,800.00	28	3.2 0	410.8 2	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5499	华大基 因	2021- 11-05	504,3 50.00	5,500.00	28	3.2 0	1,255 .27	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5501	英科医 疗	2021- 11-05	300,2 40.00	5,400.00	28	3.1 0	723.9 1	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5503	华大基 因	2021- 11-05	504,3 50.00	5,500.00	28	3.2 0	1,255 .27	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5505	英科医 疗	2021- 11-05	300,2 40.00	5,400.00	28	3.1 0	723.9 1	-	-

中信 证券	2021 1105 0005 5507	康泰生 物	2021- 11-05	195,9 30.00	1,800.00	28	2.9 0	441.9 3	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5509	欧普康 视	2021- 11-05	152,1 60.00	2,400.00	28	3.2 0	378.7 1	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5511	欧普康 视	2021- 11-05	152,1 60.00	2,400.00	28	3.2 0	378.7 1	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5513	亿联网 络	2021- 11-05	102,2 45.00	1,300.00	28	2.6 0	206.7 6	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5515	亿联网 络	2021- 11-05	102,2 45.00	1,300.00	28	2.6 0	206.7 6	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5517	亿联网 络	2021- 11-05	102,2 45.00	1,300.00	28	2.6 0	206.7 6	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5519	亿联网 络	2021- 11-05	141,5 70.00	1,800.00	28	2.6 0	286.2 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5521	康泰生 物	2021- 11-05	206,8 15.00	1,900.00	28	2.9 0	466.4 8	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5523	康泰生 物	2021- 11-05	206,8 15.00	1,900.00	28	2.9 0	466.4 8	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5525	康泰生 物	2021- 11-05	206,8 15.00	1,900.00	28	2.9 0	466.4 8	-	-
中信 证券	2021 1105 0005 5527	欧普康 视	2021- 11-05	152,1 60.00	2,400.00	28	3.2 0	378.7 1	-	-
中信	2021	沪硅产	2021-	348,1	12,200.00	28	3.6	974.9	-	-

证券	1105 0006 4819	业	11-05	88.00			0	3		
中信 证券	2021 1105 0006 4821	澜起科 技	2021- 11-05	275,0 21.00	3,700.00	28	2.6 0	556.1 5	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 4823	澜起科 技	2021- 11-05	981,1 56.00	13,200.00	28	2.6 0	1,984 .12	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 4825	中国通 号	2021- 11-05	96,82 2.00	19,800.00	28	2.9 0	218.3 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 4827	沪硅产 业	2021- 11-05	105,5 98.00	3,700.00	28	3.6 0	295.6 7	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 4829	澜起科 技	2021- 11-05	981,1 56.00	13,200.00	28	2.6 0	1,984 .12	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 4831	中国通 号	2021- 11-05	96,82 2.00	19,800.00	28	2.9 0	218.3 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 4833	中国通 号	2021- 11-05	53,79 0.00	11,000.00	28	2.9 0	121.3 3	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 4835	沪硅产 业	2021- 11-05	348,1 88.00	12,200.00	28	3.6 0	974.9 3	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 4837	中国通 号	2021- 11-05	96,82 2.00	19,800.00	28	2.9 0	218.3 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 4839	沪硅产 业	2021- 11-05	348,1 88.00	12,200.00	28	3.6 0	974.9 3	-	-
中信 证券	2021 1105	澜起科 技	2021- 11-05	981,1 56.00	13,200.00	28	2.6 0	1,984 .12	-	-

	00064841									
中信证券	2021110500065625	泰格医药	2021-11-05	363,250.00	2,500.00	28	2.60	734.57	-	-
中信证券	2021110500065627	泰格医药	2021-11-05	363,250.00	2,500.00	28	2.60	734.57	-	-
中信证券	2021110500065629	三环集团	2021-11-05	152,366.00	3,700.00	28	2.70	319.97	-	-
中信证券	2021110500065633	泰格医药	2021-11-05	363,250.00	2,500.00	28	2.60	734.57	-	-
中信证券	2021110500065637	芒果超媒	2021-11-05	604,560.00	13,200.00	28	3.10	1,457.66	-	-
中信证券	2021110500065641	芒果超媒	2021-11-05	169,460.00	3,700.00	28	3.10	408.59	-	-
中信证券	2021110500065643	三环集团	2021-11-05	210,018.00	5,100.00	28	2.70	441.04	-	-
中信证券	2021110500065645	芒果超媒	2021-11-05	604,560.00	13,200.00	28	3.10	1,457.66	-	-
中信证券	2021110500065647	三环集团	2021-11-05	210,018.00	5,100.00	28	2.70	441.04	-	-
中信证券	2021110500065649	宋城演艺	2021-11-05	99,678.00	7,400.00	28	2.00	155.05	-	-
中信证券	202111050006	宋城演艺	2021-11-05	98,331.00	7,300.00	28	2.00	152.96	-	-

	5651									
中信 证券	2021 1105 0006 5653	三环集 团	2021- 11-05	210,0 18.00	5,100.00	28	2.7 0	441.0 4	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5655	沃森生 物	2021- 11-05	376,1 69.00	7,300.00	28	2.1 0	614.4 1	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5657	泰格医 药	2021- 11-05	261,5 40.00	1,800.00	28	2.6 0	528.8 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5659	沃森生 物	2021- 11-05	376,1 69.00	7,300.00	28	2.1 0	614.4 1	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5661	宋城演 艺	2021- 11-05	99,67 8.00	7,400.00	28	2.0 0	155.0 5	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5663	阳光电 源	2021- 11-05	1,074 ,882. 00	6,900.00	28	2.6 0	2,173 .65	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5665	宋城演 艺	2021- 11-05	99,67 8.00	7,400.00	28	2.0 0	155.0 5	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5667	阳光电 源	2021- 11-05	576,3 86.00	3,700.00	28	2.6 0	1,165 .58	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5669	阳光电 源	2021- 11-05	1,074 ,882. 00	6,900.00	28	2.6 0	2,173 .65	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5671	芒果超 媒	2021- 11-05	604,5 60.00	13,200.00	28	3.1 0	1,457 .66	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5673	阳光电 源	2021- 11-05	1,074 ,882. 00	6,900.00	28	2.6 0	2,173 .65	-	-

中信 证券	2021 1105 0006 5675	健帆生 物	2021- 11-05	91,69 2.00	1,800.00	28	2.5 0	178.2 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5677	欧普康 视	2021- 11-05	114,1 20.00	1,800.00	28	3.2 0	284.0 3	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5679	温氏股 份	2021- 11-05	350,4 93.00	20,900.00	28	2.9 0	790.5 6	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5681	健帆生 物	2021- 11-05	96,78 6.00	1,900.00	28	2.5 0	188.2 0	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5683	健帆生 物	2021- 11-05	96,78 6.00	1,900.00	28	2.5 0	188.2 0	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5685	健帆生 物	2021- 11-05	96,78 6.00	1,900.00	28	2.5 0	188.2 0	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5687	贝达药 业	2021- 11-05	84,04 0.00	1,100.00	28	2.3 0	150.3 4	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5689	贝达药 业	2021- 11-05	84,04 0.00	1,100.00	28	2.3 0	150.3 4	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5691	贝达药 业	2021- 11-05	84,04 0.00	1,100.00	28	2.3 0	150.3 4	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5693	蓝思科 技	2021- 11-05	153,7 90.00	7,000.00	28	2.0 0	239.2 3	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5695	先导智 能	2021- 11-05	371,4 48.00	4,400.00	28	3.3 0	953.3 8	-	-
中信	2021	贝达药	2021-	137,5	1,800.00	28	2.3	246.0	-	-

证券	1105 0006 5697	业	11-05	20.00			0	1		
中信 证券	2021 1105 0006 5699	蓝思科 技	2021- 11-05	120,8 35.00	5,500.00	28	2.0 0	187.9 7	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5701	蓝思科 技	2021- 11-05	153,7 90.00	7,000.00	28	2.0 0	239.2 3	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5703	温氏股 份	2021- 11-05	306,8 91.00	18,300.00	28	2.9 0	692.2 1	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5705	温氏股 份	2021- 11-05	350,4 93.00	20,900.00	28	2.9 0	790.5 6	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5707	蓝思科 技	2021- 11-05	153,7 90.00	7,000.00	28	2.0 0	239.2 3	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5709	温氏股 份	2021- 11-05	350,4 93.00	20,900.00	28	2.9 0	790.5 6	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5711	先导智 能	2021- 11-05	312,3 54.00	3,700.00	28	3.3 0	801.7 1	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5713	先导智 能	2021- 11-05	371,4 48.00	4,400.00	28	3.3 0	953.3 8	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5715	亿纬锂 能	2021- 11-05	624,1 95.00	5,500.00	28	3.2 0	1,553 .55	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5717	乐普医 疗	2021- 11-05	425,7 00.00	19,800.00	28	2.8 0	927.0 8	-	-
中信 证券	2021 1105	先导智 能	2021- 11-05	371,4 48.00	4,400.00	28	3.3 0	953.3 8	-	-

	0006 5719									
中信 证券	2021 1105 0006 5721	爱尔眼 科	2021- 11-05	615,8 23.00	12,700.00	28	2.9 0	1,389 .02	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5723	乐普医 疗	2021- 11-05	425,7 00.00	19,800.00	28	2.8 0	927.0 8	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5725	亿纬锂 能	2021- 11-05	2,247 ,102. 00	19,800.00	28	3.2 0	5,592 .79	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5727	爱尔眼 科	2021- 11-05	533,3 90.00	11,000.00	28	2.9 0	1,203 .09	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5729	亿纬锂 能	2021- 11-05	2,247 ,102. 00	19,800.00	28	3.2 0	5,592 .79	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5731	乐普医 疗	2021- 11-05	425,7 00.00	19,800.00	28	2.8 0	927.0 8	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5733	爱尔眼 科	2021- 11-05	615,8 23.00	12,700.00	28	2.9 0	1,389 .02	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5735	亿纬锂 能	2021- 11-05	2,247 ,102. 00	19,800.00	28	3.2 0	5,592 .79	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5737	爱尔眼 科	2021- 11-05	615,8 23.00	12,700.00	28	2.9 0	1,389 .02	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5739	同花顺	2021- 11-05	112,9 50.00	1,000.00	28	3.2 0	281.1 2	-	-
中信 证券	2021 1105 0006	汇川技 术	2021- 11-05	497,2 76.00	7,300.00	28	2.3 0	889.5 7	-	-

	5741									
中信 证券	2021 1105 0006 5743	汇川技 术	2021- 11-05	497,2 76.00	7,300.00	28	2.3 0	889.5 7	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5745	乐普医 疗	2021- 11-05	118,2 50.00	5,500.00	28	2.8 0	257.5 2	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5747	汇川技 术	2021- 11-05	497,2 76.00	7,300.00	28	2.3 0	889.5 7	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5749	信维通 信	2021- 11-05	93,61 0.00	3,700.00	28	3.2 0	232.9 8	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5751	汇川技 术	2021- 11-05	374,6 60.00	5,500.00	28	2.3 0	670.2 3	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5753	信维通 信	2021- 11-05	333,9 60.00	13,200.00	28	3.2 0	831.1 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5755	信维通 信	2021- 11-05	333,9 60.00	13,200.00	28	3.2 0	831.1 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5757	沃森生 物	2021- 11-05	376,1 69.00	7,300.00	28	2.1 0	614.4 1	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5759	智飞生 物	2021- 11-05	491,4 34.00	3,700.00	28	2.6 0	993.7 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5761	信维通 信	2021- 11-05	333,9 60.00	13,200.00	28	3.2 0	831.1 9	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5763	沃森生 物	2021- 11-05	376,1 69.00	7,300.00	28	2.1 0	614.4 1	-	-

中信 证券	2021 1105 0006 5765	东方财 富	2021- 11-05	818,2 50.00	25,000.00	28	3.3 0	2,100 .18	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5767	同花顺	2021- 11-05	112,9 50.00	1,000.00	28	3.2 0	281.1 2	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5769	东方财 富	2021- 11-05	1,368 ,114. 00	41,800.00	28	3.3 0	3,511 .49	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5771	同花顺	2021- 11-05	203,3 10.00	1,800.00	28	3.2 0	506.0 2	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5773	同花顺	2021- 11-05	112,9 50.00	1,000.00	28	3.2 0	281.1 2	-	-
中信 证券	2021 1105 0006 5775	东方财 富	2021- 11-05	1,368 ,114. 00	41,800.00	28	3.3 0	3,511 .49	-	-
中信 证券	2021 1109 0000 0984	宋城演 艺	2021- 11-09	289,8 00.00	20,000.00	14	3.4 0	383.1 8	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7626	阳光电 源	2021- 11-09	2,114 ,772. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,441 .02	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7630	宋城演 艺	2021- 11-09	382,5 36.00	26,400.00	28	3.1 0	922.3 4	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7632	沃森生 物	2021- 11-09	1,281 ,984. 00	26,400.00	28	2.6 0	2,592 .46	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7636	爱尔眼 科	2021- 11-09	1,909 ,908. 00	39,600.00	28	2.5 0	3,713 .71	-	-
中信	2021	泰格医	2021-	933,0	6,600.00	28	2.9	2,104	-	-

证券	1109 0001 7638	药	11-09	42.00			0	.53		
中信 证券	2021 1109 0001 7640	乐普医 疗	2021- 11-09	425,1 06.00	19,800.00	28	2.9 0	958.8 5	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7642	同花顺	2021- 11-09	755,0 40.00	6,600.00	28	3.3 0	1,937 .94	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7644	信维通 信	2021- 11-09	328,1 52.00	13,200.00	28	3.3 0	842.2 6	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7646	东方财 富	2021- 11-09	4,199 ,646. 00	125,400.0 0	28	3.3 0	10,77 9.09	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7648	汇川技 术	2021- 11-09	1,408 ,572. 00	19,800.00	28	3.0 0	3,286 .67	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7650	欧普康 视	2021- 11-09	415,8 66.00	6,600.00	28	3.0 0	970.3 5	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7652	智飞生 物	2021- 11-09	1,696 ,992. 00	13,200.00	28	2.3 0	3,035 .73	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7654	康泰生 物	2021- 11-09	709,4 34.00	6,600.00	28	3.1 0	1,710 .52	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7656	亿联网 络	2021- 11-09	496,3 20.00	6,600.00	28	3.0 0	1,158 .08	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7658	华大基 因	2021- 11-09	585,4 20.00	6,600.00	28	3.3 0	1,502 .58	-	-
中信 证券	2021 1109	蓝思科 技	2021- 11-09	427,4 82.00	19,800.00	28	2.0 0	664.9 7	-	-

	0001 7660									
中信 证券	2021 1109 0001 7662	英科医 疗	2021- 11-09	352,6 38.00	6,600.00	28	3.3 0	905.1 0	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7664	芒果超 媒	2021- 11-09	580,2 72.00	13,200.00	28	3.6 0	1,624 .76	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7666	三环集 团	2021- 11-09	549,6 48.00	13,200.00	28	3.1 0	1,325 .26	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7668	贝达药 业	2021- 11-09	528,8 58.00	6,600.00	28	2.4 0	987.2 0	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7670	温氏股 份	2021- 11-09	1,106 ,820. 00	66,000.00	28	3.3 0	2,840 .84	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7672	先导智 能	2021- 11-09	1,149 ,060. 00	13,200.00	28	2.8 0	2,502 .40	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7674	健帆生 物	2021- 11-09	323,3 34.00	6,600.00	28	3.2 0	804.7 4	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7676	澜起科 技	2021- 11-09	1,003 ,200. 00	13,200.00	28	2.0 0	1,560 .53	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7678	沪硅产 业	2021- 11-09	383,3 28.00	13,200.00	28	3.4 0	1,013 .69	-	-
中信 证券	2021 1109 0001 7680	中国通 号	2021- 11-09	194,8 32.00	39,600.00	28	3.0 0	454.6 1	-	-
中信 证券	2021 1111 0000	温氏股 份	2021- 11-11	51,18 0.00	3,000.00	14	3.5 0	69.66	-	-

	0914									
中信 证券	2021 1112 0000 3845	澜起科 技	2021- 11-12	1,019 ,040. 00	13,200.00	28	2.0 0	1,585 .17	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3847	中国通 号	2021- 11-12	196,0 20.00	39,600.00	28	3.0 0	457.3 8	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3849	沪硅产 业	2021- 11-12	394,0 20.00	13,200.00	28	3.4 0	1,041 .96	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3851	蓝思科 技	2021- 11-12	454,0 14.00	19,800.00	28	2.0 0	706.2 4	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3853	先导智 能	2021- 11-12	1,152 ,228. 00	13,200.00	28	2.8 0	2,509 .30	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3855	健帆生 物	2021- 11-12	353,6 94.00	6,600.00	28	3.2 0	880.3 1	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3857	欧普康 视	2021- 11-12	414,3 48.00	6,600.00	28	3.0 0	966.8 1	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3859	温氏股 份	2021- 11-12	1,158 ,960. 00	66,000.00	28	3.3 0	2,974 .66	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3861	康泰生 物	2021- 11-12	700,2 60.00	6,600.00	28	3.1 0	1,688 .40	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3863	芒果超 媒	2021- 11-12	558,0 96.00	13,200.00	28	3.6 0	1,562 .67	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3865	三环集 团	2021- 11-12	563,9 04.00	13,200.00	28	3.1 0	1,359 .64	-	-

中信 证券	2021 1112 0000 3867	东方财 富	2021- 11-12	4,442 ,922. 00	125,400.0 0	28	3.3 0	11,40 3.50	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3869	亿联网 络	2021- 11-12	518,7 60.00	6,600.00	28	3.0 0	1,210 .44	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3871	同花顺	2021- 11-12	765,1 38.00	6,600.00	28	3.3 0	1,963 .85	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3873	智飞生 物	2021- 11-12	1,687 ,488. 00	13,200.00	28	2.3 0	3,018 .73	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3875	贝达药 业	2021- 11-12	580,8 00.00	6,600.00	28	2.4 0	1,084 .16	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3877	汇川技 术	2021- 11-12	1,396 ,098. 00	19,800.00	28	3.0 0	3,257 .56	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3879	爱尔眼 科	2021- 11-12	1,884 ,564. 00	39,600.00	28	2.5 0	3,664 .43	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3881	阳光电 源	2021- 11-12	2,121 ,504. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,455 .16	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3883	泰格医 药	2021- 11-12	942,4 80.00	6,600.00	28	2.9 0	2,125 .82	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3885	宋城演 艺	2021- 11-12	384,1 20.00	26,400.00	28	3.1 0	926.1 6	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 3887	华大基 因	2021- 11-12	585,7 50.00	6,600.00	28	3.3 0	1,503 .43	-	-
中信	2021	沃森生	2021-	1,388	26,400.00	28	2.6	2,808	-	-

证券	1112 0000 4459	物	11-12	,640. 00			0	.14		
中信 证券	2021 1112 0000 4461	英科医 疗	2021- 11-12	362,2 74.00	6,600.00	28	3.3 0	929.8 4	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 4463	亿纬锂 能	2021- 11-12	2,605 ,482. 00	19,800.00	28	3.0 0	6,079 .46	-	-
中信 证券	2021 1112 0000 4465	乐普医 疗	2021- 11-12	439,9 56.00	19,800.00	28	2.9 0	992.3 5	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6467	沃森生 物	2021- 11-15	616,0 00.00	11,000.00	14	3.3 0	790.5 3	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6469	贝达药 业	2021- 11-15	183,1 80.00	2,000.00	14	3.5 0	249.3 3	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6471	沪硅产 业	2021- 11-15	147,1 00.00	5,000.00	14	3.7 0	211.6 6	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6473	信维通 信	2021- 11-15	133,8 50.00	5,000.00	14	3.4 0	176.9 8	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6475	温氏股 份	2021- 11-15	479,7 90.00	27,000.00	14	3.5 0	653.0 5	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6477	健帆生 物	2021- 11-15	111,3 20.00	2,000.00	14	3.5 0	151.5 2	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6479	同花顺	2021- 11-15	229,8 80.00	2,000.00	14	3.5 0	312.8 9	-	-
中信 证券	2021 1115	亿纬锂 能	2021- 11-15	1,017 ,520.	8,000.00	14	3.6 0	1,424 .53	-	-

	0000 6481			00						
中信 证券	2021 1115 0000 6483	阳光电 源	2021- 11-15	750,4 00.00	5,000.00	14	3.4 0	992.2 0	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6485	华大基 因	2021- 11-15	181,8 40.00	2,000.00	14	2.6 0	183.8 6	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6487	汇川技 术	2021- 11-15	563,9 20.00	8,000.00	14	3.5 0	767.5 6	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6489	乐普医 疗	2021- 11-15	180,0 80.00	8,000.00	14	3.4 0	238.1 1	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6491	三环集 团	2021- 11-15	216,4 00.00	5,000.00	14	3.3 0	277.7 1	-	-
中信 证券	2021 1115 0000 6493	英科医 疗	2021- 11-15	111,0 00.00	2,000.00	14	2.4 0	103.6 0	-	-
中信 证券	2021 1116 0000 4410	温氏股 份	2021- 11-16	34,72 0.00	2,000.00	14	3.5 0	47.26	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5891	中国通 号	2021- 11-17	4,970 .00	1,000.00	28	3.0 0	11.60	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5893	贝达药 业	2021- 11-17	89,66 0.00	1,000.00	28	3.4 0	237.1 0	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5895	沃森生 物	2021- 11-17	60,18 0.00	1,000.00	28	3.2 0	149.7 8	-	-
中信 证券	2021 1117 0000	中微公 司	2021- 11-17	164,1 70.00	1,000.00	28	3.7 0	472.4 4	-	-

	5897									
中信 证券	2021 1117 0000 5899	石头科 技	2021- 11-17	888,0 00.00	1,000.00	28	2.8 0	1,933 .87	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5901	宋城演 艺	2021- 11-17	14,95 0.00	1,000.00	28	3.3 0	38.37	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5903	澜起科 技	2021- 11-17	74,51 0.00	1,000.00	28	3.0 0	173.8 6	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5905	沪硅产 业	2021- 11-17	29,05 0.00	1,000.00	28	3.6 0	81.34	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5907	阳光电 源	2021- 11-17	152,1 50.00	1,000.00	28	3.3 0	390.5 2	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5909	温氏股 份	2021- 11-17	17,10 0.00	1,000.00	28	3.4 0	45.22	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5911	泰格医 药	2021- 11-17	150,5 30.00	1,000.00	28	3.3 0	386.3 6	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5913	健帆生 物	2021- 11-17	55,77 0.00	1,000.00	28	3.4 0	147.4 8	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5915	同花顺	2021- 11-17	113,9 00.00	1,000.00	28	3.4 0	301.2 0	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5917	亿纬锂 能	2021- 11-17	125,9 00.00	1,000.00	28	3.5 0	342.7 3	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5919	华大基 因	2021- 11-17	92,55 0.00	1,000.00	28	2.5 0	179.9 6	-	-

中信 证券	2021 1117 0000 5921	东方财 富	2021- 11-17	35,15 0.00	1,000.00	28	2.8 0	76.55	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5923	蓝思科 技	2021- 11-17	22,96 0.00	1,000.00	28	2.8 0	50.00	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5925	华润微	2021- 11-17	332,6 00.00	5,000.00	28	1.0 0	258.6 9	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5927	汇川技 术	2021- 11-17	67,08 0.00	1,000.00	28	3.4 0	177.3 9	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5929	先导智 能	2021- 11-17	80,97 0.00	1,000.00	28	3.3 0	207.8 2	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5931	乐普医 疗	2021- 11-17	22,47 0.00	1,000.00	28	3.3 0	57.67	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5933	欧普康 视	2021- 11-17	66,42 0.00	1,000.00	28	3.3 0	170.4 8	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5935	智飞生 物	2021- 11-17	135,8 00.00	1,000.00	28	2.6 0	274.6 2	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5937	三环集 团	2021- 11-17	42,10 0.00	1,000.00	28	3.2 0	104.7 8	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5939	爱尔眼 科	2021- 11-17	790,8 80.00	16,000.00	28	3.1 0	1,906 .90	-	-
中信 证券	2021 1117 0000 5941	英科医 疗	2021- 11-17	57,07 0.00	1,000.00	28	2.3 0	102.0 9	-	-
中信	2021	华熙生	2021-	170,7	1,000.00	28	2.6	345.3	-	-

证券	1117 0000 5943	物	11-17	80.00			0	6		
中信 证券	2021 1117 0000 5945	康泰生 物	2021- 11-17	114,3 30.00	1,000.00	28	2.9 0	257.8 8	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5701	沃森生 物	2021- 11-18	1,601 ,424. 00	26,400.00	28	3.2 0	3,985 .77	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5703	澜起科 技	2021- 11-18	984,8 52.00	13,200.00	28	3.0 0	2,297 .99	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5711	沃森生 物	2021- 11-18	606,6 00.00	10,000.00	28	3.2 0	1,509 .76	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5715	蓝思科 技	2021- 11-18	441,3 42.00	19,800.00	28	2.8 0	961.1 4	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5717	欧普康 视	2021- 11-18	1,183 ,700. 00	19,000.00	14	3.4 0	1,565 .11	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5723	东方财 富	2021- 11-18	4,350 ,126. 00	125,400.0 0	28	2.8 0	9,473 .61	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5727	泰格医 药	2021- 11-18	963,6 00.00	6,600.00	28	3.3 0	2,473 .24	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5729	沪硅产 业	2021- 11-18	378,1 80.00	13,200.00	28	3.6 0	1,058 .90	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5731	康泰生 物	2021- 11-18	738,6 06.00	6,600.00	28	2.9 0	1,665 .97	-	-
中信 证券	2021 1118	贝达药 业	2021- 11-18	586,8 06.00	6,600.00	28	3.4 0	1,551 .78	-	-

	0000 5733									
中信 证券	2021 1118 0000 5735	宋城演 艺	2021- 11-18	382,0 08.00	26,400.00	28	3.3 0	980.4 9	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5737	健帆生 物	2021- 11-18	357,0 60.00	6,600.00	28	3.4 0	944.2 3	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5739	智飞生 物	2021- 11-18	1,754 ,808. 00	13,200.00	28	2.6 0	3,548 .61	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5741	华大基 因	2021- 11-18	598,0 26.00	6,600.00	28	2.5 0	1,162 .83	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5743	温氏股 份	2021- 11-18	1,155 ,000. 00	66,000.00	28	3.4 0	3,054 .33	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5745	欧普康 视	2021- 11-18	411,1 80.00	6,600.00	28	3.3 0	1,055 .36	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5747	先导智 能	2021- 11-18	1,056 ,000. 00	13,200.00	28	3.3 0	2,710 .40	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5749	亿纬锂 能	2021- 11-18	2,514 ,600. 00	19,800.00	28	3.5 0	6,845 .30	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5751	阳光电 源	2021- 11-18	1,974 ,852. 00	13,200.00	28	3.3 0	5,068 .79	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5753	汇川技 术	2021- 11-18	1,306 ,800. 00	19,800.00	28	3.4 0	3,455 .76	-	-
中信 证券	2021 1118 0000	同花顺	2021- 11-18	733,3 92.00	6,600.00	28	3.4 0	1,939 .41	-	-

	5755									
中信 证券	2021 1118 0000 5757	三环集 团	2021- 11-18	543,5 76.00	13,200.00	28	3.2 0	1,352 .90	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 5759	乐普医 疗	2021- 11-18	438,9 66.00	19,800.00	28	3.3 0	1,126 .68	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 6245	亿联网 络	2021- 11-18	527,0 10.00	6,600.00	28	3.3 0	1,352 .66	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 6247	芒果超 媒	2021- 11-18	611,9 52.00	13,200.00	28	3.1 0	1,475 .48	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 6249	爱尔眼 科	2021- 11-18	1,888 ,920. 00	39,600.00	28	3.1 0	4,554 .40	-	-
中信 证券	2021 1118 0000 6251	中国通 号	2021- 11-18	195,2 28.00	39,600.00	28	3.0 0	455.5 3	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 4510	同花顺	2021- 11-22	617,0 84.00	5,200.00	28	2.3 0	1,103 .89	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 4512	乐普医 疗	2021- 11-22	341,8 02.00	15,300.00	28	3.3 0	877.2 9	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6280	健帆生 物	2021- 11-22	276,9 00.00	5,200.00	28	3.4 0	732.2 5	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6282	华大基 因	2021- 11-22	468,6 24.00	5,200.00	28	5.4 0	1,968 .22	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6284	沃森生 物	2021- 11-22	1,234 ,100. 00	20,500.00	28	3.3 0	3,167 .52	-	-

中信 证券	2021 1122 0001 6286	汇川技术	2021- 11-22	1,016 ,226. 00	15,300.00	28	2.9 0	2,292 .15	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6288	亿纬锂能	2021- 11-22	2,135 ,574. 00	15,300.00	28	3.1 0	5,149 .11	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6290	英科医疗	2021- 11-22	284,1 28.00	5,200.00	28	3.1 0	685.0 6	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6292	贝达药业	2021- 11-22	449,6 96.00	5,200.00	28	3.4 0	1,189 .20	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6294	沪硅产业	2021- 11-22	304,9 83.00	10,300.00	28	3.4 0	806.5 1	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6296	阳光电源	2021- 11-22	1,627 ,709. 00	10,300.00	28	2.8 0	3,544 .79	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6298	温氏股份	2021- 11-22	871,7 44.00	51,400.00	28	3.4 0	2,305 .28	-	-
中信 证券	2021 1122 0001 6300	三环集团	2021- 11-22	445,5 78.00	10,300.00	28	3.2 0	1,108 .99	-	-
中信 证券	2021 1123 0000 0884	爱尔眼科	2021- 11-23	281,1 60.00	6,000.00	14	2.9 0	317.0 9	-	-
中信 证券	2021 1123 0001 2756	宋城演艺	2021- 11-23	287,2 00.00	20,000.00	14	3.4 0	379.7 4	-	-
中信 证券	2021 1125 0000 7934	温氏股份	2021- 11-25	48,39 0.00	3,000.00	14	3.5 0	65.86	-	-
中信	2021	英科医	2021-	121,3	2,000.00	14	3.3	155.6	-	-

证券	1129 0000 4135	疗	11-29	00.00			0	7		
中信 证券	2021 1129 0000 4137	健帆生 物	2021- 11-29	106,1 80.00	2,000.00	14	3.5 0	144.5 2	-	-
中信 证券	2021 1129 0000 4139	亿纬锂 能	2021- 11-29	1,184 ,000. 00	8,000.00	14	2.8 0	1,289 .24	-	-
中信 证券	2021 1129 0000 4141	沃森生 物	2021- 11-29	750,7 50.00	11,000.00	14	3.4 0	992.6 6	-	-
中信 证券	2021 1129 0000 4143	阳光电 源	2021- 11-29	791,1 00.00	5,000.00	14	3.0 0	922.9 5	-	-
中信 证券	2021 1129 0000 4145	汇川技 术	2021- 11-29	533,0 40.00	8,000.00	14	3.2 0	663.3 4	-	-
中信 证券	2021 1129 0000 4147	贝达药 业	2021- 11-29	167,4 60.00	2,000.00	14	3.3 0	214.9 1	-	-
中信 证券	2021 1129 0000 4149	乐普医 疗	2021- 11-29	178,2 40.00	8,000.00	14	3.4 0	235.6 7	-	-
中信 证券	2021 1129 0000 4151	温氏股 份	2021- 11-29	435,5 10.00	27,000.00	14	3.3 0	558.9 0	-	-
中信 证券	2021 1129 0000 4153	三环集 团	2021- 11-29	208,2 50.00	5,000.00	14	3.5 0	283.4 5	-	-
中信 证券	2021 1129 0000 4155	同花顺	2021- 11-29	232,7 40.00	2,000.00	14	3.2 0	289.6 3	-	-
中信 证券	2021 1129	华大基 因	2021- 11-29	185,2 80.00	2,000.00	14	5.9 0	425.1 1	-	-

	0000 4157									
中信 证券	2021 1129 0000 4159	沪硅产 业	2021- 11-29	144,8 00.00	5,000.00	14	3.0 0	168.9 3	-	-
中信 证券	2021 1130 0000 4743	温氏股 份	2021- 11-30	31,90 0.00	2,000.00	14	3.3 0	40.94	-	-
中信 证券	2021 1203 0000 0962	爱尔眼 科	2021- 12-03	6,322 ,500. 00	150,000.0 0	14	3.5 0	8,605 .63	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1241	沪硅产 业	2021- 12-03	348,6 76.00	12,200.00	28	2.9 0	786.4 6	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1243	沪硅产 业	2021- 12-03	348,6 76.00	12,200.00	28	2.9 0	786.4 6	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1245	中国通 号	2021- 12-03	55,11 0.00	11,000.00	28	3.1 0	132.8 8	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1247	中国通 号	2021- 12-03	99,19 8.00	19,800.00	28	3.1 0	239.1 8	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1249	澜起科 技	2021- 12-03	1,018 ,644. 00	13,200.00	28	3.1 0	2,456 .06	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1251	沪硅产 业	2021- 12-03	105,7 46.00	3,700.00	28	2.9 0	238.5 2	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1253	澜起科 技	2021- 12-03	1,018 ,644. 00	13,200.00	28	3.1 0	2,456 .06	-	-
中信 证券	2021 1203 0002	中国通 号	2021- 12-03	99,19 8.00	19,800.00	28	3.1 0	239.1 8	-	-

	1255									
中信 证券	2021 1203 0002 1257	沪硅产 业	2021- 12-03	348,6 76.00	12,200.00	28	2.9 0	786.4 6	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1259	中国通 号	2021- 12-03	99,19 8.00	19,800.00	28	3.1 0	239.1 8	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1261	澜起科 技	2021- 12-03	285,5 29.00	3,700.00	28	3.1 0	688.4 4	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1263	澜起科 技	2021- 12-03	1,018 ,644. 00	13,200.00	28	3.1 0	2,456 .06	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1269	亿纬锂 能	2021- 12-03	2,894 ,760. 00	19,800.00	28	2.7 0	6,079 .00	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1271	亿纬锂 能	2021- 12-03	2,894 ,760. 00	19,800.00	28	2.7 0	6,079 .00	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1273	爱尔眼 科	2021- 12-03	535,3 05.00	12,700.00	28	2.8 0	1,165 .78	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1275	爱尔眼 科	2021- 12-03	535,3 05.00	12,700.00	28	2.8 0	1,165 .78	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1277	爱尔眼 科	2021- 12-03	535,3 05.00	12,700.00	28	2.8 0	1,165 .78	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1279	亿纬锂 能	2021- 12-03	804,1 00.00	5,500.00	28	2.7 0	1,688 .61	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1281	乐普医 疗	2021- 12-03	433,2 24.00	19,800.00	28	3.3 0	1,111 .94	-	-

中信 证券	2021 1203 0002 1283	乐普医 疗	2021- 12-03	433,2 24.00	19,800.00	28	3.3 0	1,111 .94	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1285	乐普医 疗	2021- 12-03	120,3 40.00	5,500.00	28	3.3 0	308.8 7	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1287	亿纬锂 能	2021- 12-03	2,894 ,760. 00	19,800.00	28	2.7 0	6,079 .00	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1289	乐普医 疗	2021- 12-03	433,2 24.00	19,800.00	28	3.3 0	1,111 .94	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1291	爱尔眼 科	2021- 12-03	463,6 50.00	11,000.00	28	2.8 0	1,009 .73	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1293	智飞生 物	2021- 12-03	464,5 12.00	3,800.00	28	2.8 0	1,011 .60	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1295	智飞生 物	2021- 12-03	452,2 88.00	3,700.00	28	2.8 0	984.9 8	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1297	智飞生 物	2021- 12-03	464,5 12.00	3,800.00	28	2.8 0	1,011 .60	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1299	智飞生 物	2021- 12-03	464,5 12.00	3,800.00	28	2.8 0	1,011 .60	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1301	汇川技 术	2021- 12-03	362,2 30.00	5,500.00	28	3.1 0	873.3 8	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1303	汇川技 术	2021- 12-03	480,7 78.00	7,300.00	28	3.1 0	1,159 .21	-	-
中信	2021	同花顺	2021-	219,7	1,800.00	28	3.1	529.7	-	-

证券	1203 0002 1305		12-03	08.00			0	4		
中信 证券	2021 1203 0002 1307	汇川技 术	2021- 12-03	480,7 78.00	7,300.00	28	3.1 0	1,159 .21	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1309	同花顺	2021- 12-03	122,0 60.00	1,000.00	28	3.1 0	294.3 0	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1311	汇川技 术	2021- 12-03	480,7 78.00	7,300.00	28	3.1 0	1,159 .21	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1313	同花顺	2021- 12-03	122,0 60.00	1,000.00	28	3.1 0	294.3 0	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1315	同花顺	2021- 12-03	122,0 60.00	1,000.00	28	3.1 0	294.3 0	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1317	东方财 富	2021- 12-03	1,457 ,566. 00	41,800.00	28	3.1 0	3,514 .35	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1319	东方财 富	2021- 12-03	871,7 50.00	25,000.00	28	3.1 0	2,101 .89	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1321	东方财 富	2021- 12-03	1,457 ,566. 00	41,800.00	28	3.1 0	3,514 .35	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1323	东方财 富	2021- 12-03	1,457 ,566. 00	41,800.00	28	3.1 0	3,514 .35	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1325	贝达药 业	2021- 12-03	88,45 1.00	1,100.00	28	3.2 0	220.1 4	-	-
中信 证券	2021 1203	贝达药 业	2021- 12-03	144,7 38.00	1,800.00	28	3.2 0	360.2 4	-	-

	0002 1327									
中信 证券	2021 1203 0002 1329	欧普康 视	2021- 12-03	133,4 64.00	2,400.00	28	2.4 0	249.1 3	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1331	贝达药 业	2021- 12-03	88,45 1.00	1,100.00	28	3.2 0	220.1 4	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1333	温氏股 份	2021- 12-03	365,7 50.00	20,900.00	28	3.2 0	910.3 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1335	欧普康 视	2021- 12-03	133,4 64.00	2,400.00	28	2.4 0	249.1 3	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1337	欧普康 视	2021- 12-03	100,0 98.00	1,800.00	28	2.4 0	186.8 5	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1339	温氏股 份	2021- 12-03	365,7 50.00	20,900.00	28	3.2 0	910.3 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1341	贝达药 业	2021- 12-03	88,45 1.00	1,100.00	28	3.2 0	220.1 4	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1343	健帆生 物	2021- 12-03	90,99 0.00	1,800.00	28	3.4 0	240.6 2	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1345	温氏股 份	2021- 12-03	320,2 50.00	18,300.00	28	3.2 0	797.0 7	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1347	欧普康 视	2021- 12-03	133,4 64.00	2,400.00	28	2.4 0	249.1 3	-	-
中信 证券	2021 1203 0002	温氏股 份	2021- 12-03	365,7 50.00	20,900.00	28	3.2 0	910.3 1	-	-

	1349									
中信 证券	2021 1203 0002 1351	健帆生 物	2021- 12-03	96,04 5.00	1,900.00	28	3.4 0	253.9 9	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1353	健帆生 物	2021- 12-03	96,04 5.00	1,900.00	28	3.4 0	253.9 9	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1355	华大基 因	2021- 12-03	165,0 42.00	1,800.00	28	5.8 0	744.5 2	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1357	健帆生 物	2021- 12-03	96,04 5.00	1,900.00	28	3.4 0	253.9 9	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1359	华大基 因	2021- 12-03	504,2 95.00	5,500.00	28	5.8 0	2,274 .93	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1361	华大基 因	2021- 12-03	504,2 95.00	5,500.00	28	5.8 0	2,274 .93	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1363	华大基 因	2021- 12-03	504,2 95.00	5,500.00	28	5.8 0	2,274 .93	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1365	英科医 疗	2021- 12-03	328,5 90.00	5,400.00	28	3.2 0	817.8 2	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1367	英科医 疗	2021- 12-03	328,5 90.00	5,400.00	28	3.2 0	817.8 2	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1369	英科医 疗	2021- 12-03	328,5 90.00	5,400.00	28	3.2 0	817.8 2	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1371	康泰生 物	2021- 12-03	209,9 69.00	1,900.00	28	3.0 0	489.9 3	-	-

中信 证券	2021 1203 0002 1373	康泰生 物	2021- 12-03	209,9 69.00	1,900.00	28	3.0 0	489.9 3	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1375	康泰生 物	2021- 12-03	209,9 69.00	1,900.00	28	3.0 0	489.9 3	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1377	亿联网 络	2021- 12-03	98,02 0.00	1,300.00	28	3.0 0	228.7 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1379	康泰生 物	2021- 12-03	198,9 18.00	1,800.00	28	3.0 0	464.1 4	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1381	亿联网 络	2021- 12-03	135,7 20.00	1,800.00	28	3.0 0	316.6 8	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1383	亿联网 络	2021- 12-03	98,02 0.00	1,300.00	28	3.0 0	228.7 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1385	阳光电 源	2021- 12-03	1,055 ,631. 00	6,900.00	28	2.9 0	2,381 .03	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1387	亿联网 络	2021- 12-03	98,02 0.00	1,300.00	28	3.0 0	228.7 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1389	阳光电 源	2021- 12-03	1,055 ,631. 00	6,900.00	28	2.9 0	2,381 .03	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1391	阳光电 源	2021- 12-03	566,0 63.00	3,700.00	28	2.9 0	1,276 .79	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 1393	阳光电 源	2021- 12-03	1,055 ,631. 00	6,900.00	28	2.9 0	2,381 .03	-	-
中信	2021	泰格医	2021-	340,5	2,500.00	28	2.9	768.0	-	-

证券	1203 0002 1395	药	12-03	00.00			0	2		
中信 证券	2021 1203 0002 3241	泰格医 药	2021- 12-03	340,5 00.00	2,500.00	28	2.9 0	768.0 2	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3243	泰格医 药	2021- 12-03	245,1 60.00	1,800.00	28	2.9 0	552.9 7	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3245	泰格医 药	2021- 12-03	340,5 00.00	2,500.00	28	2.9 0	768.0 2	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3247	沃森生 物	2021- 12-03	480,9 24.00	7,300.00	28	3.3 0	1,234 .37	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3249	沃森生 物	2021- 12-03	480,9 24.00	7,300.00	28	3.3 0	1,234 .37	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3251	沃森生 物	2021- 12-03	480,9 24.00	7,300.00	28	3.3 0	1,234 .37	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3253	沃森生 物	2021- 12-03	480,9 24.00	7,300.00	28	3.3 0	1,234 .37	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3255	宋城演 艺	2021- 12-03	98,56 8.00	7,400.00	28	3.2 0	245.3 2	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3257	宋城演 艺	2021- 12-03	97,23 6.00	7,300.00	28	3.2 0	242.0 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3259	宋城演 艺	2021- 12-03	98,56 8.00	7,400.00	28	3.2 0	245.3 2	-	-
中信 证券	2021 1203	宋城演 艺	2021- 12-03	98,56 8.00	7,400.00	28	3.2 0	245.3 2	-	-

	0002 3261									
中信 证券	2021 1203 0002 3263	蓝思科 技	2021- 12-03	145,8 80.00	7,000.00	28	2.4 0	272.3 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3265	蓝思科 技	2021- 12-03	145,8 80.00	7,000.00	28	2.4 0	272.3 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3267	蓝思科 技	2021- 12-03	145,8 80.00	7,000.00	28	2.4 0	272.3 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3269	先导智 能	2021- 12-03	300,6 62.00	3,700.00	28	3.2 0	748.3 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3271	先导智 能	2021- 12-03	357,5 44.00	4,400.00	28	3.2 0	889.8 9	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3273	先导智 能	2021- 12-03	357,5 44.00	4,400.00	28	3.2 0	889.8 9	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3275	三环集 团	2021- 12-03	225,0 63.00	5,100.00	28	3.4 0	595.1 7	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3277	先导智 能	2021- 12-03	357,5 44.00	4,400.00	28	3.2 0	889.8 9	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3279	三环集 团	2021- 12-03	163,2 81.00	3,700.00	28	3.4 0	431.7 9	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3281	芒果超 媒	2021- 12-03	579,3 48.00	13,200.00	28	3.3 0	1,486 .99	-	-
中信 证券	2021 1203 0002	蓝思科 技	2021- 12-03	114,6 20.00	5,500.00	28	2.4 0	213.9 6	-	-

	3283									
中信 证券	2021 1203 0002 3285	三环集 团	2021- 12-03	225,0 63.00	5,100.00	28	3.4 0	595.1 7	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3287	芒果超 媒	2021- 12-03	162,3 93.00	3,700.00	28	3.3 0	416.8 1	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3289	三环集 团	2021- 12-03	225,0 63.00	5,100.00	28	3.4 0	595.1 7	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3291	芒果超 媒	2021- 12-03	579,3 48.00	13,200.00	28	3.3 0	1,486 .99	-	-
中信 证券	2021 1203 0002 3293	芒果超 媒	2021- 12-03	579,3 48.00	13,200.00	28	3.3 0	1,486 .99	-	-
中信 证券	2021 1207 0000 1091	亿联网 络	2021- 12-07	84,04 0.00	1,000.00	14	3.4 0	111.1 2	-	-
中信 证券	2021 1207 0000 1092	温氏股 份	2021- 12-07	52,62 0.00	3,000.00	14	3.4 0	69.58	-	-
中信 证券	2021 1207 0000 8669	英科医 疗	2021- 12-07	389,4 00.00	6,600.00	28	3.4 0	882.6 4	381,744.00	882.6 4
中信 证券	2021 1207 0000 8671	华大基 因	2021- 12-07	593,9 34.00	6,600.00	28	5.8 0	2,296 .54	579,480.00	2,296 .54
中信 证券	2021 1207 0000 8673	温氏股 份	2021- 12-07	1,157 ,640. 00	66,000.00	28	3.2 0	2,469 .63	1,271,160.0 0	2,469 .63
中信 证券	2021 1207 0000 8675	泰格医 药	2021- 12-07	889,6 14.00	6,600.00	28	3.2 0	1,897 .84	843,480.00	1,897 .84

中信 证券	2021 1207 0000 8677	汇川技术	2021- 12-07	1,297 ,494. 00	19,800.00	28	2.7 0	2,335 .49	1,358,280.0 0	2,335 .49
中信 证券	2021 1207 0000 8679	先导智能	2021- 12-07	1,030 ,656. 00	13,200.00	28	3.4 0	2,336 .15	981,684.00	2,336 .15
中信 证券	2021 1207 0000 8687	阳光电源	2021- 12-07	1,962 ,840. 00	13,200.00	28	3.3 0	4,318 .25	1,924,560.0 0	4,318 .25
中信 证券	2021 1207 0000 8691	沪硅产业	2021- 12-07	358,7 76.00	13,200.00	28	1.9 0	454.4 5	340,824.00	454.4 5
中信 证券	2021 1207 0000 8693	东方财富	2021- 12-07	4,445 ,430. 00	125,400.0 0	28	3.3 0	9,779 .95	4,653,594.0 0	9,779 .95
中信 证券	2021 1207 0000 8695	宋城演艺	2021- 12-07	272,2 00.00	20,000.00	14	3.3 0	349.3 2	-	-
中信 证券	2021 1207 0000 8697	宋城演艺	2021- 12-07	359,3 04.00	26,400.00	28	3.2 0	766.5 2	378,048.00	766.5 2
中信 证券	2021 1207 0000 8699	同花顺	2021- 12-07	822,6 90.00	6,600.00	28	3.3 0	1,809 .92	954,228.00	1,809 .92
中信 证券	2021 1207 0000 8701	爱尔眼科	2021- 12-07	257,9 40.00	6,000.00	14	3.5 0	351.0 9	-	-
中信 证券	2021 1207 0000 8703	爱尔眼科	2021- 12-07	1,702 ,404. 00	39,600.00	28	3.4 0	3,858 .78	1,674,288.0 0	3,858 .78
中信 证券	2021 1207 0000 8705	贝达药业	2021- 12-07	537,2 40.00	6,600.00	28	3.4 0	1,217 .74	526,878.00	1,217 .74
中信	2021	中国通	2021-	198,0	39,600.00	28	3.5	462.0	197,208.00	462.0

证券	1207 0000 8707	号	12-07	00.00			0	0		0
中信 证券	2021 1207 0000 8709	蓝思科 技	2021- 12-07	424,7 10.00	19,800.00	28	2.1 0	594.5 9	455,004.00	594.5 9
中信 证券	2021 1207 0000 8711	沃森生 物	2021- 12-07	1,658 ,976. 00	26,400.00	28	3.4 0	3,760 .35	1,483,680.0 0	3,760 .35
中信 证券	2021 1207 0000 8713	亿联网 络	2021- 12-07	554,6 64.00	6,600.00	28	3.4 0	1,257 .24	537,570.00	1,257 .24
中信 证券	2021 1209 0000 0738	宋城演 艺	2021- 12-09	238,0 00.00	17,000.00	14	3.4 0	314.6 9	-	-
中信 证券	2021 1209 0000 0896	中微公 司	2021- 12-09	7,600 ,000. 00	50,000.00	14	8.1 0	23,94 0.00	-	-
中信 证券	2021 1209 0000 6891	温氏股 份	2021- 12-09	52,35 0.00	3,000.00	14	3.3 0	67.18	-	-
中信 证券	2021 1210 0000 4359	同花顺	2021- 12-10	845,1 30.00	6,600.00	28	3.3 0	1,626 .88	954,228.00	1,626 .88
中信 证券	2021 1210 0000 4361	东方财 富	2021- 12-10	4,627 ,260. 00	125,400.0 0	28	3.3 0	8,907 .47	4,653,594.0 0	8,907 .47
中信 证券	2021 1210 0000 4369	汇川技 术	2021- 12-10	1,402 ,830. 00	19,800.00	28	2.7 0	2,209 .46	1,358,280.0 0	2,209 .46
中信 证券	2021 1210 0000 4373	沃森生 物	2021- 12-10	1,623 ,600. 00	26,400.00	28	3.4 0	3,220 .14	1,483,680.0 0	3,220 .14
中信 证券	2021 1210	阳光电 源	2021- 12-10	1,979 ,868.	13,200.00	28	3.3 0	3,811 .25	1,924,560.0 0	3,811 .25

	0000 4383			00						
中信 证券	2021 1210 0000 4385	芒果超 媒	2021- 12-10	608,6 52.00	13,200.00	28	3.3 0	1,171 .66	755,304.00	1,171 .66
中信 证券	2021 1210 0000 4557	沪硅产 业	2021- 12-10	368,8 08.00	13,200.00	28	1.9 0	408.7 7	340,824.00	408.7 7
中信 证券	2021 1210 0000 4851	澜起科 技	2021- 12-10	990,0 00.00	13,200.00	28	2.7 0	1,559 .25	1,107,084.0 0	1,559 .25
中信 证券	2021 1210 0000 4927	智飞生 物	2021- 12-10	1,679 ,964. 00	13,200.00	28	3.1 0	3,037 .94	1,644,720.0 0	3,037 .94
中信 证券	2021 1210 0000 4929	宋城演 艺	2021- 12-10	366,1 68.00	26,400.00	28	3.2 0	683.5 1	378,048.00	683.5 1
中信 证券	2021 1210 0000 4931	泰格医 药	2021- 12-10	940,5 00.00	6,600.00	28	3.2 0	1,755 .60	843,480.00	1,755 .60
中信 证券	2021 1210 0000 4933	三环集 团	2021- 12-10	614,8 56.00	13,200.00	28	3.4 0	1,219 .46	588,720.00	1,219 .46
中信 证券	2021 1210 0000 6075	蓝思科 技	2021- 12-10	449,2 62.00	19,800.00	28	2.1 0	550.3 4	455,004.00	550.3 4
中信 证券	2021 1210 0000 6077	先导智 能	2021- 12-10	1,069 ,068. 00	13,200.00	28	3.4 0	2,120 .32	981,684.00	2,120 .32
中信 证券	2021 1210 0000 6079	温氏股 份	2021- 12-10	1,139 ,820. 00	66,000.00	28	3.2 0	2,127 .67	1,271,160.0 0	2,127 .67
中信 证券	2021 1210 0000	健帆生 物	2021- 12-10	341,2 86.00	6,600.00	28	3.3 0	656.9 8	351,780.00	656.9 8

	6083									
中信 证券	2021 1210 0000 6085	贝达药 业	2021- 12-10	541,9 26.00	6,600.00	28	3.4 0	1,074 .82	526,878.00	1,074 .82
中信 证券	2021 1210 0000 6089	亿联网 络	2021- 12-10	557,9 64.00	6,600.00	28	3.4 0	1,106 .63	537,570.00	1,106 .63
中信 证券	2021 1210 0000 6091	华大基 因	2021- 12-10	608,5 86.00	6,600.00	28	5.8 0	2,059 .05	579,480.00	2,059 .05
中信 证券	2021 1210 0000 6097	英科医 疗	2021- 12-10	394,8 78.00	6,600.00	28	3.4 0	783.1 7	381,744.00	783.1 7
中信 证券	2021 1210 0000 6163	乐普医 疗	2021- 12-10	435,6 00.00	19,800.00	28	3.3 0	838.5 3	448,074.00	838.5 3
中信 证券	2021 1210 0000 6165	亿纬锂 能	2021- 12-10	2,716 ,956. 00	19,800.00	28	3.3 0	5,230 .14	2,339,964.0 0	5,230 .14
中信 证券	2021 1210 0000 6167	爱尔眼 科	2021- 12-10	1,756 ,260. 00	39,600.00	28	3.4 0	3,483 .25	1,674,288.0 0	3,483 .25
中信 证券	2021 1210 0000 6683	欧普康 视	2021- 12-10	413,2 92.00	6,600.00	28	3.4 0	819.7 0	378,642.00	819.7 0
中信 证券	2021 1210 0000 6685	康泰生 物	2021- 12-10	743,7 54.00	6,600.00	28	3.2 0	1,388 .34	650,364.00	1,388 .34
中信 证券	2021 1210 0000 6689	中国通 号	2021- 12-10	198,0 00.00	39,600.00	28	3.5 0	404.2 5	197,208.00	404.2 5
中信 证券	2021 1213 0000 9331	沪硅产 业	2021- 12-13	138,4 00.00	5,000.00	14	1.8 0	96.88	-	-

中信 证券	2021 1213 0000 9333	同花顺	2021- 12-13	264,1 80.00	2,000.00	14	3.5 0	359.5 8	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9335	阳光电 源	2021- 12-13	740,4 50.00	5,000.00	14	3.4 0	979.0 4	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9337	三环集 团	2021- 12-13	230,9 00.00	5,000.00	14	3.4 0	305.3 0	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9339	汇川技 术	2021- 12-13	572,4 00.00	8,000.00	14	3.3 0	734.5 8	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9341	温氏股 份	2021- 12-13	471,4 20.00	27,000.00	14	3.4 0	623.3 2	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9343	沃森生 物	2021- 12-13	673,2 00.00	11,000.00	14	3.4 0	890.1 2	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9345	健帆生 物	2021- 12-13	105,6 80.00	2,000.00	14	2.9 0	119.1 8	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9347	贝达药 业	2021- 12-13	164,3 80.00	2,000.00	14	3.5 0	223.7 4	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9349	华大基 因	2021- 12-13	184,8 60.00	2,000.00	14	5.9 0	424.1 5	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9351	英科医 疗	2021- 12-13	118,6 40.00	2,000.00	14	3.5 0	161.4 8	-	-
中信 证券	2021 1213 0000 9353	亿纬锂 能	2021- 12-13	1,099 ,440. 00	8,000.00	14	3.0 0	1,282 .68	-	-
中信	2021	乐普医	2021-	174,3	8,000.00	14	3.5	237.2	-	-

证券	1213 0000 9357	疗	12-13	20.00			0	7		
中信 证券	2021 1214 0000 1111	迈瑞医 疗	2021- 12-14	742,6 00.00	2,000.00	14	1.8 0	519.8 2	-	-
中信 证券	2021 1214 0000 1115	健帆生 物	2021- 12-14	212,7 20.00	4,000.00	14	1.8 0	148.9 0	-	-
中信 证券	2021 1214 0000 1117	爱尔眼 科	2021- 12-14	837,5 20.00	19,000.00	14	1.8 0	586.2 6	-	-
中信 证券	2021 1214 0000 1119	乐普医 疗	2021- 12-14	239,6 90.00	11,000.00	14	1.8 0	167.7 8	-	-
中信 证券	2021 1214 0000 1503	健帆生 物	2021- 12-14	531,8 00.00	10,000.00	14	3.5 0	723.8 4	-	-
中信 证券	2021 1214 0001 1136	温氏股 份	2021- 12-14	35,38 0.00	2,000.00	14	3.4 0	46.78	-	-
中信 证券	2021 1215 0001 5773	亿纬锂 能	2021- 12-15	132,0 00.00	1,000.00	28	2.9 0	170.1 3	118,180.00	170.1 3
中信 证券	2021 1215 0001 5775	同花顺	2021- 12-15	136,5 20.00	1,000.00	28	3.4 0	206.3 0	144,580.00	206.3 0
中信 证券	2021 1215 0001 5777	东方财 富	2021- 12-15	38,67 0.00	1,000.00	28	2.1 0	36.09	37,110.00	36.09
中信 证券	2021 1215 0001 5779	乐普医 疗	2021- 12-15	21,60 0.00	1,000.00	28	3.4 0	32.64	22,630.00	32.64
中信 证券	2021 1215	宋城演 艺	2021- 12-15	13,82 0.00	1,000.00	28	3.3 0	20.27	14,320.00	20.27

	0001 5781									
中信 证券	2021 1215 0001 5783	阳光电 源	2021- 12-15	149,1 00.00	1,000.00	28	3.3 0	218.6 8	145,800.00	218.6 8
中信 证券	2021 1215 0001 5785	汇川技 术	2021- 12-15	68,85 0.00	1,000.00	28	3.2 0	97.92	68,600.00	97.92
中信 证券	2021 1215 0001 5787	泰格医 药	2021- 12-15	128,6 00.00	1,000.00	28	3.3 0	188.6 1	127,800.00	188.6 1
中信 证券	2021 1215 0001 5789	沃森生 物	2021- 12-15	62,57 0.00	1,000.00	28	3.3 0	91.77	56,200.00	91.77
中信 证券	2021 1215 0001 5791	智飞生 物	2021- 12-15	129,8 50.00	1,000.00	28	3.3 0	190.4 5	124,600.00	190.4 5
中信 证券	2021 1215 0001 5793	健帆生 物	2021- 12-15	52,32 0.00	1,000.00	28	2.8 0	65.11	53,300.00	65.11
中信 证券	2021 1215 0001 5795	贝达药 业	2021- 12-15	80,86 0.00	1,000.00	28	3.4 0	122.1 9	79,830.00	122.1 9
中信 证券	2021 1215 0001 5797	温氏股 份	2021- 12-15	17,59 0.00	1,000.00	28	3.3 0	25.80	19,260.00	25.80
中信 证券	2021 1215 0001 5799	三环集 团	2021- 12-15	45,40 0.00	1,000.00	28	3.3 0	66.59	44,600.00	66.59
中信 证券	2021 1215 0001 5801	蓝思科 技	2021- 12-15	24,35 0.00	1,000.00	28	2.1 0	22.73	22,980.00	22.73
中信 证券	2021 1215 0001	先导智 能	2021- 12-15	85,09 0.00	1,000.00	28	3.3 0	124.8 0	74,370.00	124.8 0

	5803									
中信 证券	2021 1215 0001 5805	欧普康 视	2021- 12-15	60,78 0.00	1,000.00	28	3.5 0	94.55	57,370.00	94.55
中信 证券	2021 1215 0001 5807	英科医 疗	2021- 12-15	58,12 0.00	1,000.00	28	3.4 0	87.83	57,840.00	87.83
中信 证券	2021 1215 0001 5809	康泰生 物	2021- 12-15	111,5 10.00	1,000.00	28	3.3 0	163.5 5	98,540.00	163.5 5
中信 证券	2021 1215 0001 5811	华大基 因	2021- 12-15	90,20 0.00	1,000.00	28	5.8 0	232.5 1	87,800.00	232.5 1
中信 证券	2021 1215 0001 5813	石头科 技	2021- 12-15	810,0 00.00	1,000.00	28	3.4 0	1,224 .00	813,000.00	1,224 .00
中信 证券	2021 1215 0001 5815	华熙生 物	2021- 12-15	168,0 10.00	1,000.00	28	6.0 0	448.0 3	155,300.00	448.0 3
中信 证券	2021 1215 0001 5817	华润微	2021- 12-15	338,5 00.00	5,000.00	28	1.4 0	210.6 2	323,000.00	210.6 2
中信 证券	2021 1215 0001 5819	中国通 号	2021- 12-15	4,930 .00	1,000.00	28	2.8 0	6.14	4,980.00	6.14
中信 证券	2021 1215 0001 5821	中微公 司	2021- 12-15	145,1 50.00	1,000.00	28	8.0 0	516.0 9	126,600.00	516.0 9
中信 证券	2021 1215 0001 5823	澜起科 技	2021- 12-15	76,55 0.00	1,000.00	28	4.7 0	159.9 0	83,870.00	159.9 0
中信 证券	2021 1215 0001 5825	沪硅产 业	2021- 12-15	27,10 0.00	1,000.00	28	1.7 0	20.47	25,820.00	20.47

中信 证券	2021 1216 0000 1343	稳健医 疗	2021- 12-16	638,8 00.00	8,000.00	28	3.7 0	984.8 1	659,600.00	984.8 1
中信 证券	2021 1216 0000 1345	爱美客	2021- 12-16	1,138 ,100. 00	1,900.00	28	5.5 0	2,608 .15	1,018,609.0 0	2,608 .15
中信 证券	2021 1216 0000 1347	金龙鱼	2021- 12-16	804,9 26.00	12,700.00	28	3.1 0	1,039 .70	799,211.00	1,039 .70
中信 证券	2021 1216 0000 1349	亿纬锂 能	2021- 12-16	1,350 ,000. 00	10,000.00	28	3.3 0	1,856 .25	1,181,800.0 0	1,856 .25
中信 证券	2021 1216 0000 1351	乐普医 疗	2021- 12-16	242,2 56.00	11,200.00	28	2.8 0	282.6 3	253,456.00	282.6 3
中信 证券	2021 1216 0000 1355	欧普康 视	2021- 12-16	275,9 68.00	4,400.00	28	2.2 0	252.9 7	252,428.00	252.9 7
中信 证券	2021 1216 0000 1357	康泰生 物	2021- 12-16	403,3 00.00	3,700.00	28	2.8 0	470.5 2	364,598.00	470.5 2
中信 证券	2021 1216 0000 1363	亿联网 络	2021- 12-16	268,0 96.00	3,200.00	28	3.3 0	368.6 3	260,640.00	368.6 3
中信 证券	2021 1216 0000 1367	温氏股 份	2021- 12-16	676,4 76.00	38,700.00	28	3.1 0	873.7 8	745,362.00	873.7 8
中信 证券	2021 1216 0000 1373	华大基 因	2021- 12-16	198,1 32.00	2,200.00	28	2.7 0	222.9 0	193,160.00	222.9 0
中信 证券	2021 1216 0000 1374	贝达药 业	2021- 12-16	174,7 68.00	2,200.00	28	1.8 0	131.0 8	175,626.00	131.0 8
中信	2021	健帆生	2021-	220,2	4,200.00	28	3.4	311.9	223,860.00	311.9

证券	1216 0000 1375	物	12-16	06.00			0	6		6
中信 证券	2021 1216 0000 1380	迈瑞医 疗	2021- 12-16	2,089 ,450. 00	5,800.00	28	2.3 0	2,002 .39	2,208,640.0 0	2,002 .39
中信 证券	2021 1216 0000 1381	卓胜微	2021- 12-16	1,230 ,804. 00	3,600.00	28	3.2 0	1,641 .07	1,176,480.0 0	1,641 .07
中信 证券	2021 1216 0000 1387	宁德时代	2021- 12-16	8,450 ,274. 00	12,900.00	28	3.1 0	10,91 4.94	7,585,200.0 0	10,91 4.94
中信 证券	2021 1216 0000 1388	先导智 能	2021- 12-16	804,5 18.00	9,700.00	28	3.4 0	1,139 .73	721,389.00	1,139 .73
中信 证券	2021 1216 0000 1389	安克创 新	2021- 12-16	719,2 45.00	6,700.00	28	3.7 0	1,108 .84	686,750.00	1,108 .84
中信 证券	2021 1216 0000 1390	英科医 疗	2021- 12-16	198,0 84.00	3,400.00	28	3.4 0	280.6 2	196,656.00	280.6 2
中信 证券	2021 1216 0000 1391	康龙化 成	2021- 12-16	900,6 00.00	5,700.00	28	2.8 0	1,050 .70	805,239.00	1,050 .70
中信 证券	2021 1216 0000 1398	爱尔眼 科	2021- 12-16	1,026 ,600. 00	23,600.00	28	3.2 0	1,368 .80	997,808.00	1,368 .80
中信 证券	2021 1216 0000 1399	同花顺	2021- 12-16	248,3 46.00	1,800.00	28	2.9 0	300.0 9	260,244.00	300.0 9
中信 证券	2021 1216 0000 1401	智飞生 物	2021- 12-16	916,5 80.00	7,000.00	28	2.1 0	802.0 1	872,200.00	802.0 1
中信 证券	2021 1216	沃森生 物	2021- 12-16	907,0 74.00	13,800.00	28	3.2 0	1,209 .43	775,560.00	1,209 .43

	0000 1402									
中信 证券	2021 1216 0000 1403	汇川技 术	2021- 12-16	1,153 ,600. 00	16,000.00	28	3.0 0	1,442 .00	1,097,600.0 0	1,442 .00
中信 证券	2021 1216 0000 1409	东方财 富	2021- 12-16	2,730 ,112. 00	70,400.00	28	2.4 0	2,730 .11	2,612,544.0 0	2,730 .11
中信 证券	2021 1216 0000 1411	宋城演 艺	2021- 12-16	203,0 79.00	13,900.00	28	3.2 0	270.7 7	199,048.00	270.7 7
中信 证券	2021 1216 0000 1413	三环集 团	2021- 12-16	514,4 89.00	11,300.00	28	2.6 0	557.3 6	503,980.00	557.3 6
中信 证券	2021 1216 0000 1414	阳光电 源	2021- 12-16	1,419 ,459. 00	9,300.00	28	2.7 0	1,596 .89	1,355,940.0 0	1,596 .89
中信 证券	2021 1216 0000 1415	芒果超 媒	2021- 12-16	331,7 62.00	6,200.00	28	3.2 0	442.3 5	354,764.00	442.3 5
中信 证券	2021 1216 0000 1418	蓝思科 技	2021- 12-16	412,7 60.00	17,000.00	28	2.0 0	343.9 7	390,660.00	343.9 7
中信 证券	2021 1216 0000 1421	泰格医 药	2021- 12-16	616,2 17.00	4,700.00	28	2.9 0	744.5 9	600,660.00	744.5 9
中信 证券	2021 1216 0000 1423	晶盛机 电	2021- 12-16	981,8 55.00	13,500.00	28	2.7 0	1,104 .59	938,250.00	1,104 .59
中信 证券	2021 1216 0000 1581	传音控 股	2021- 12-16	338,6 46.00	2,200.00	28	3.0 0	423.3 1	345,180.00	423.3 1
中信 证券	2021 1216 0000	金山办 公	2021- 12-16	432,6 16.00	1,700.00	28	3.0 0	540.7 7	450,500.00	540.7 7

	1583									
中信 证券	2021 1216 0000 1585	中微公 司	2021- 12-16	320,7 60.00	2,200.00	28	3.5 0	467.7 8	278,520.00	467.7 8
中信 证券	2021 1216 0000 1587	奇安信	2021- 12-16	783,2 00.00	8,000.00	28	3.9 0	1,272 .70	703,360.00	1,272 .70
中信 证券	2021 1216 0000 1588	澜起科 技	2021- 12-16	332,1 41.00	4,100.00	28	3.1 0	429.0 2	343,867.00	429.0 2
中信 证券	2021 1216 0000 1591	中芯国 际	2021- 12-16	1,474 ,944. 00	27,600.00	28	1.4 0	860.3 8	1,462,524.0 0	860.3 8
中信 证券	2021 1216 0000 1593	沪硅产 业	2021- 12-16	178,8 60.00	6,600.00	28	5.0 0	372.6 3	170,412.00	372.6 3
中信 证券	2021 1216 0000 1595	华润微	2021- 12-16	161,7 36.00	2,400.00	28	1.3 0	87.61	155,040.00	87.61
中信 证券	2021 1216 0000 1596	中国通 号	2021- 12-16	113,3 55.00	22,900.00	28	2.5 0	118.0 8	114,042.00	118.0 8
中信 证券	2021 1216 0000 1599	华熙生 物	2021- 12-16	169,1 70.00	1,000.00	28	4.9 0	345.3 9	155,300.00	345.3 9
中信 证券	2021 1216 0000 1601	天合光 能	2021- 12-16	1,152 ,024. 00	13,800.00	28	4.9 0	2,352 .05	1,088,820.0 0	2,352 .05
中信 证券	2021 1217 0002 7634	爱尔眼 科	2021- 12-17	6,424 ,500. 00	150,000.0 0	14	3.2 0	7,994 .93	-	-
中信 证券	2021 1220 0000 9523	沪硅产 业	2021- 12-20	258,5 30.00	10,300.00	28	5.0 0	394.9 7	265,946.00	394.9 7

中信 证券	2021 1220 0000 9533	健帆生 物	2021- 12-20	265,1 48.00	5,200.00	28	3.4 0	275.4 6	277,160.00	275.4 6
中信 证券	2021 1220 0000 9535	华大基 因	2021- 12-20	468,1 04.00	5,200.00	28	2.7 0	386.1 9	456,560.00	386.1 9
中信 证券	2021 1220 0000 9537	英科医 疗	2021- 12-20	311,7 92.00	5,200.00	28	3.4 0	323.9 2	300,768.00	323.9 2
中信 证券	2021 1220 0000 9539	亿纬锂 能	2021- 12-20	1,881 ,747. 00	15,300.00	28	3.3 0	1,897 .43	1,808,154.0 0	1,897 .43
中信 证券	2021 1220 0000 9541	同花顺	2021- 12-20	719,0 04.00	5,200.00	28	2.9 0	637.1 2	751,816.00	637.1 2
中信 证券	2021 1220 0000 9543	乐普医 疗	2021- 12-20	327,5 73.00	15,300.00	28	2.8 0	280.2 6	346,239.00	280.2 6
中信 证券	2021 1220 0000 9545	阳光电 源	2021- 12-20	1,417 ,280. 00	10,300.00	28	2.7 0	1,169 .26	1,501,740.0 0	1,169 .26
中信 证券	2021 1220 0000 9547	沃森生 物	2021- 12-20	1,312 ,410. 00	20,500.00	28	3.2 0	1,283 .24	1,152,100.0 0	1,283 .24
中信 证券	2021 1220 0000 9549	汇川技 术	2021- 12-20	1,075 ,896. 00	15,300.00	28	3.0 0	986.2 4	1,049,580.0 0	986.2 4
中信 证券	2021 1220 0000 9551	三环集 团	2021- 12-20	462,2 64.00	10,300.00	28	2.6 0	367.2 4	459,380.00	367.2 4
中信 证券	2021 1220 0000 9553	贝达药 业	2021- 12-20	404,1 44.00	5,200.00	28	1.8 0	222.2 8	415,116.00	222.2 8
中信	2021	温氏股	2021-	910,8	51,400.00	28	3.1	862.7	989,964.00	862.7

证券	1220 0000 9555	份	12-20	08.00			0	4		4
中信 证券	2021 1221 0001 9741	宋城演 艺	2021- 12-21	274,0 00.00	20,000.00	14	3.3 0	251.1 6	286,400.00	251.1 6
中信 证券	2021 1221 0001 9743	爱尔眼 科	2021- 12-21	258,7 20.00	6,000.00	14	3.3 0	237.1 6	253,680.00	237.1 6
中信 证券	2021 1223 0000 1062	爱尔眼 科	2021- 12-23	1,622 ,600. 00	38,000.00	28	3.1 0	1,117 .79	1,606,640.0 0	1,117 .79
中信 证券	2021 1223 0000 1073	爱尔眼 科	2021- 12-23	1,622 ,600. 00	38,000.00	14	3.2 0	1,153 .85	1,606,640.0 0	1,153 .85
中信 证券	2021 1223 0001 1491	中微公 司	2021- 12-23	6,422 ,500. 00	50,000.00	14	3.6 0	5,138 .00	6,330,000.0 0	5,138 .00
中信 证券	2021 1223 0001 1503	宋城演 艺	2021- 12-23	233,4 10.00	17,000.00	14	3.3 0	171.1 7	243,440.00	171.1 7
中信 证券	2021 1227 0000 1137	爱尔眼 科	2021- 12-27	2,036 ,737. 00	46,300.00	14	3.3 0	746.8 0	1,957,564.0 0	746.8 0
中信 证券	2021 1227 0000 9136	乐普医 疗	2021- 12-27	184,1 60.00	8,000.00	14	3.0 0	61.39	181,040.00	61.39
中信 证券	2021 1227 0000 9338	亿纬锂 能	2021- 12-27	948,0 00.00	8,000.00	14	3.1 0	326.5 3	945,440.00	326.5 3
中信 证券	2021 1227 0000 9340	汇川技 术	2021- 12-27	560,0 00.00	8,000.00	14	2.7 0	168.0 0	548,800.00	168.0 0
中信 证券	2021 1227	同花顺	2021- 12-27	273,1 80.00	2,000.00	14	3.3 0	100.1 7	289,160.00	100.1 7

	0000 9342									
中信 证券	2021 1227 0000 9344	沃森生 物	2021- 12-27	647,6 80.00	11,000.00	14	3.3 0	237.4 8	618,200.00	237.4 8
中信 证券	2021 1227 0000 9346	英科医 疗	2021- 12-27	115,3 00.00	2,000.00	14	3.3 0	42.28	115,680.00	42.28
中信 证券	2021 1227 0000 9348	三环集 团	2021- 12-27	219,7 50.00	5,000.00	14	2.7 0	65.93	223,000.00	65.93
中信 证券	2021 1227 0000 9350	阳光电 源	2021- 12-27	678,5 00.00	5,000.00	14	3.2 0	241.2 5	729,000.00	241.2 5
中信 证券	2021 1227 0000 9352	华大基 因	2021- 12-27	179,7 40.00	2,000.00	14	2.9 0	57.92	175,600.00	57.92
中信 证券	2021 1227 0000 9354	温氏股 份	2021- 12-27	523,8 00.00	27,000.00	14	3.3 0	192.0 6	520,020.00	192.0 6
中信 证券	2021 1227 0000 9356	贝达药 业	2021- 12-27	164,5 20.00	2,000.00	14	3.0 0	54.84	159,660.00	54.84
中信 证券	2021 1227 0000 9358	健帆生 物	2021- 12-27	104,3 60.00	2,000.00	14	3.3 0	38.27	106,600.00	38.27
中信 证券	2021 1227 0000 9734	沪硅产 业	2021- 12-27	132,0 00.00	5,000.00	14	2.8 0	41.07	129,100.00	41.07
中信 证券	2021 1228 0000 1542	阳光电 源	2021- 12-28	416,5 50.00	3,000.00	14	3.1 0	107.6 1	437,400.00	107.6 1
中信 证券	2021 1228 0001	健帆生 物	2021- 12-28	212,8 00.00	4,000.00	14	1.8 0	31.92	213,200.00	31.92

	3198									
中信 证券	2021 1228 0001 3202	迈瑞医 疗	2021- 12-28	758,0 00.00	2,000.00	14	1.8 0	113.7 0	761,600.00	113.7 0
中信 证券	2021 1228 0001 3204	爱尔眼 科	2021- 12-28	828,4 00.00	19,000.00	14	1.8 0	124.2 6	803,320.00	124.2 6
中信 证券	2021 1228 0001 3208	乐普医 疗	2021- 12-28	250,8 00.00	11,000.00	14	1.8 0	37.62	248,930.00	37.62
中信 证券	2021 1229 0000 1050	三环集 团	2021- 12-29	360,5 52.00	8,300.00	28	2.6 0	52.08	370,180.00	52.08
中信 证券	2021 1229 0000 1052	东方财 富	2021- 12-29	36,31 0,000 .00	1,000,000. 00	7	3.4 0	6,858 .55	37,110,000. 00	6,858 .55
中信 证券	2021 1229 0000 1054	华大基 因	2021- 12-29	141,1 04.00	1,600.00	28	2.5 0	19.60	140,480.00	19.60
中信 证券	2021 1229 0000 1055	英科医 疗	2021- 12-29	143,2 25.00	2,500.00	28	3.3 0	26.26	144,600.00	26.26
中信 证券	2021 1229 0000 1058	温氏股 份	2021- 12-29	539,1 15.00	28,300.00	28	3.2 0	95.84	545,058.00	95.84
中信 证券	2021 1229 0000 1059	先导智 能	2021- 12-29	517,2 35.00	7,100.00	28	2.8 0	80.46	528,027.00	80.46
中信 证券	2021 1229 0000 1063	芒果超 媒	2021- 12-29	227,9 25.00	4,500.00	28	3.4 0	43.05	257,490.00	43.05
中信 证券	2021 1229 0000 1065	健帆生 物	2021- 12-29	161,8 82.00	3,100.00	28	3.2 0	28.78	165,230.00	28.78

中信 证券	2021 1229 0000 1066	康泰生 物	2021- 12-29	270,7 56.00	2,700.00	28	2.6 0	39.11	266,058.00	39.11
中信 证券	2021 1229 0000 1070	亿联网 络	2021- 12-29	186,4 15.00	2,300.00	28	2.8 0	29.00	187,335.00	29.00
中信 证券	2021 1229 0000 1073	蓝思科 技	2021- 12-29	285,2 00.00	12,400.00	28	2.5 0	39.61	284,952.00	39.61
中信 证券	2021 1229 0000 1076	贝达药 业	2021- 12-29	127,3 60.00	1,600.00	28	2.9 0	20.52	127,728.00	20.52
中信 证券	2021 1229 0000 1078	欧普康 视	2021- 12-29	188,4 16.00	3,200.00	28	2.7 0	28.26	183,584.00	28.26
中信 证券	2021 1229 0000 1080	东方财 富	2021- 12-29	1,866 ,334. 00	51,400.00	28	3.2 0	331.7 9	1,907,454.0 0	331.7 9
中信 证券	2021 1229 0000 1082	汇川技 术	2021- 12-29	811,3 95.00	11,700.00	28	2.8 0	126.2 2	802,620.00	126.2 2
中信 证券	2021 1229 0000 1084	亿纬锂 能	2021- 12-29	878,8 47.00	7,300.00	28	2.8 0	136.7 1	862,714.00	136.7 1
中信 证券	2021 1229 0000 1085	沃森生 物	2021- 12-29	577,8 21.00	10,100.00	28	2.9 0	93.09	567,620.00	93.09
中信 证券	2021 1229 0000 1088	智飞生 物	2021- 12-29	639,3 36.00	5,100.00	28	2.4 0	85.25	635,460.00	85.25
中信 证券	2021 1229 0000 1090	爱尔眼 科	2021- 12-29	748,0 28.00	17,200.00	28	3.2 0	132.9 8	727,216.00	132.9 8
中信	2021	宋城演	2021-	145,4	10,200.00	28	3.3	26.67	146,064.00	26.67

证券	1229 0000 1091	艺	12-29	52.00			0			
中信 证券	2021 1229 0000 1092	泰格医 药	2021- 12-29	424,2 86.00	3,400.00	28	2.4 0	56.57	434,520.00	56.57
中信 证券	2021 1229 0000 1096	阳光电 源	2021- 12-29	941,7 32.00	6,800.00	28	3.0 0	156.9 6	991,440.00	156.9 6
中信 证券	2021 1229 0000 1098	同花顺	2021- 12-29	184,1 06.00	1,300.00	28	2.9 0	29.66	187,954.00	29.66
中信 证券	2021 1229 0000 1100	乐普医 疗	2021- 12-29	186,3 86.00	8,200.00	28	3.1 0	32.10	185,566.00	32.10
中信 证券	2021 1229 0000 1102	中微公 司	2021- 12-29	198,4 80.00	1,600.00	28	3.0 0	18.90	202,560.00	-
中信 证券	2021 1229 0000 1104	华润微	2021- 12-29	114,5 34.00	1,800.00	28	1.4 0	5.09	116,280.00	-
中信 证券	2021 1229 0000 1106	中国通 号	2021- 12-29	83,16 6.00	16,700.00	28	2.1 0	5.54	83,166.00	-
中信 证券	2021 1229 0000 1108	澜起科 技	2021- 12-29	235,8 00.00	3,000.00	28	2.7 0	20.21	251,610.00	-
中信 证券	2021 1229 0000 1110	传音控 股	2021- 12-29	243,0 40.00	1,600.00	28	2.1 0	16.20	251,040.00	-
中信 证券	2021 1229 0000 1112	金山办 公	2021- 12-29	313,2 48.00	1,200.00	28	2.2 0	21.88	318,000.00	-
中信 证券	2021 1229	华熙生 物	2021- 12-29	156,2 00.00	1,000.00	28	3.2 0	15.87	155,300.00	-

	0000 1114									
中信 证券	2021 1229 0000 1116	沪硅产 业	2021- 12-29	122,5 44.00	4,800.00	28	3.3 0	12.84	123,936.00	-
中信 证券	2021 1230 0000 1558	爱尔眼 科	2021- 12-30	2,007 ,900. 00	46,000.00	14	3.3 0	184.0 6	1,944,880.0 0	184.0 6
中信 证券	2021 1231 0000 1151	蓝思科 技	2021- 12-31	39,06 6.00	1,700.00	14	1.8 0	-	39,066.00	-
中信 证券	2021 1231 0000 1160	汇川技 术	2021- 12-31	68,60 0.00	1,000.00	14	1.8 0	-	68,600.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6608	中国通 号	2021- 12-31	98,60 4.00	19,800.00	28	2.1 0	-	98,604.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6610	沪硅产 业	2021- 12-31	315,0 04.00	12,200.00	28	2.7 0	-	315,004.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6612	澜起科 技	2021- 12-31	1,107 ,084. 00	13,200.00	28	2.4 0	-	1,107,084.0 0	-
中信 证券	2021 1231 0002 6614	阳光电 源	2021- 12-31	539,4 60.00	3,700.00	28	3.1 0	-	539,460.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6616	汇川技 术	2021- 12-31	377,3 00.00	5,500.00	28	2.6 0	-	377,300.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6618	宋城演 艺	2021- 12-31	104,5 36.00	7,300.00	28	3.3 0	-	104,536.00	-
中信 证券	2021 1231 0002	蓝思科 技	2021- 12-31	126,3 90.00	5,500.00	28	2.0 0	-	126,390.00	-

	6620									
中信 证券	2021 1231 0002 6622	沃森生 物	2021- 12-31	410,2 60.00	7,300.00	28	3.2 0	-	410,260.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6624	泰格医 药	2021- 12-31	230,0 40.00	1,800.00	28	2.7 0	-	230,040.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6626	芒果超 媒	2021- 12-31	211,7 14.00	3,700.00	28	3.3 0	-	211,714.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6628	三环集 团	2021- 12-31	165,0 20.00	3,700.00	28	2.6 0	-	165,020.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6630	乐普医 疗	2021- 12-31	124,4 65.00	5,500.00	28	2.9 0	-	124,465.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6632	智飞生 物	2021- 12-31	461,0 20.00	3,700.00	28	2.3 0	-	461,020.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6634	亿纬锂 能	2021- 12-31	649,9 90.00	5,500.00	28	3.0 0	-	649,990.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6636	同花顺	2021- 12-31	260,2 44.00	1,800.00	28	3.2 0	-	260,244.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6638	爱尔眼 科	2021- 12-31	465,0 80.00	11,000.00	28	3.1 0	-	465,080.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6640	东方财 富	2021- 12-31	927,7 50.00	25,000.00	28	2.7 0	-	927,750.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6642	亿纬锂 能	2021- 12-31	2,339 ,964. 00	19,800.00	28	3.0 0	-	2,339,964.0 0	-

中信 证券	2021 1231 0002 6644	爱尔眼 科	2021- 12-31	536,9 56.00	12,700.00	28	3.1 0	-	536,956.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6646	乐普医 疗	2021- 12-31	448,0 74.00	19,800.00	28	2.9 0	-	448,074.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6648	先导智 能	2021- 12-31	327,2 28.00	4,400.00	28	3.1 0	-	327,228.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6650	芒果超 媒	2021- 12-31	755,3 04.00	13,200.00	28	3.3 0	-	755,304.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6652	蓝思科 技	2021- 12-31	160,8 60.00	7,000.00	28	2.0 0	-	160,860.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6654	温氏股 份	2021- 12-31	402,5 34.00	20,900.00	28	3.2 0	-	402,534.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6656	健帆生 物	2021- 12-31	101,2 70.00	1,900.00	28	3.2 0	-	101,270.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6658	欧普康 视	2021- 12-31	137,6 88.00	2,400.00	28	3.0 0	-	137,688.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6660	贝达药 业	2021- 12-31	87,81 3.00	1,100.00	28	2.9 0	-	87,813.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6662	三环集 团	2021- 12-31	227,4 60.00	5,100.00	28	2.6 0	-	227,460.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6664	康泰生 物	2021- 12-31	187,2 26.00	1,900.00	28	2.8 0	-	187,226.00	-
中信	2021	同花顺	2021-	144,5	1,000.00	28	3.2	-	144,580.00	-

证券	1231 0002 6666		12-31	80.00			0			
中信 证券	2021 1231 0002 6668	智飞生 物	2021- 12-31	473,4 80.00	3,800.00	28	2.3 0	-	473,480.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6670	东方财 富	2021- 12-31	1,551 ,198. 00	41,800.00	28	2.7 0	-	1,551,198.0 0	-
中信 证券	2021 1231 0002 6672	阳光电 源	2021- 12-31	1,006 ,020. 00	6,900.00	28	3.1 0	-	1,006,020.0 0	-
中信 证券	2021 1231 0002 6674	宋城演 艺	2021- 12-31	105,9 68.00	7,400.00	28	3.3 0	-	105,968.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6676	汇川技 术	2021- 12-31	500,7 80.00	7,300.00	28	2.6 0	-	500,780.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6678	泰格医 药	2021- 12-31	319,5 00.00	2,500.00	28	2.7 0	-	319,500.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6680	沃森生 物	2021- 12-31	410,2 60.00	7,300.00	28	3.2 0	-	410,260.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6682	亿联网 络	2021- 12-31	105,8 85.00	1,300.00	28	3.1 0	-	105,885.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6684	华大基 因	2021- 12-31	482,9 00.00	5,500.00	28	2.8 0	-	482,900.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6686	英科医 疗	2021- 12-31	312,3 36.00	5,400.00	28	3.2 0	-	312,336.00	-
中信 证券	2021 1231	爱尔眼 科	2021- 12-31	6,342 ,000.	150,000.0 0	14	3.2 0	-	6,342,000.0 0	-

	0002 6688			00						
中信 证券	2021 1231 0002 6690	澜起科 技	2021- 12-31	310,3 19.00	3,700.00	28	2.4 0	-	310,319.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6692	中国通 号	2021- 12-31	54,78 0.00	11,000.00	28	2.1 0	-	54,780.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6694	沪硅产 业	2021- 12-31	95,53 4.00	3,700.00	28	2.7 0	-	95,534.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6696	健帆生 物	2021- 12-31	95,94 0.00	1,800.00	28	3.2 0	-	95,940.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6698	贝达药 业	2021- 12-31	143,6 94.00	1,800.00	28	2.9 0	-	143,694.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6700	亿联网 络	2021- 12-31	146,6 10.00	1,800.00	28	3.1 0	-	146,610.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6702	先导智 能	2021- 12-31	275,1 69.00	3,700.00	28	3.1 0	-	275,169.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 6704	温氏股 份	2021- 12-31	352,4 58.00	18,300.00	28	3.2 0	-	352,458.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8078	华大基 因	2021- 12-31	158,0 40.00	1,800.00	28	2.8 0	-	158,040.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8080	欧普康 视	2021- 12-31	103,2 66.00	1,800.00	28	3.0 0	-	103,266.00	-
中信 证券	2021 1231 0002	康泰生 物	2021- 12-31	177,3 72.00	1,800.00	28	2.8 0	-	177,372.00	-

	8082									
中信 证券	2021 1231 0002 8084	亿纬锂 能	2021- 12-31	2,339 ,964. 00	19,800.00	28	3.0 0	-	2,339,964.0 0	-
中信 证券	2021 1231 0002 8086	乐普医 疗	2021- 12-31	448,0 74.00	19,800.00	28	2.9 0	-	448,074.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8088	爱尔眼 科	2021- 12-31	536,9 56.00	12,700.00	28	3.1 0	-	536,956.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8090	同花顺	2021- 12-31	144,5 80.00	1,000.00	28	3.2 0	-	144,580.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8092	蓝思科 技	2021- 12-31	160,8 60.00	7,000.00	28	2.0 0	-	160,860.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8094	温氏股 份	2021- 12-31	402,5 34.00	20,900.00	28	3.2 0	-	402,534.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8096	先导智 能	2021- 12-31	327,2 28.00	4,400.00	28	3.1 0	-	327,228.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8098	健帆生 物	2021- 12-31	101,2 70.00	1,900.00	28	3.2 0	-	101,270.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8100	康泰生 物	2021- 12-31	187,2 26.00	1,900.00	28	2.8 0	-	187,226.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8102	贝达药 业	2021- 12-31	87,81 3.00	1,100.00	28	2.9 0	-	87,813.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8104	欧普康 视	2021- 12-31	137,6 88.00	2,400.00	28	3.0 0	-	137,688.00	-

中信 证券	2021 1231 0002 8106	亿联网络	2021- 12-31	105,8 85.00	1,300.00	28	3.1 0	-	105,885.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8108	汇川技术	2021- 12-31	500,7 80.00	7,300.00	28	2.6 0	-	500,780.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8110	智飞生物	2021- 12-31	473,4 80.00	3,800.00	28	2.3 0	-	473,480.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8112	芒果超媒	2021- 12-31	755,3 04.00	13,200.00	28	3.3 0	-	755,304.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8114	沃森生物	2021- 12-31	410,2 60.00	7,300.00	28	3.2 0	-	410,260.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8116	东方财富	2021- 12-31	1,551 ,198. 00	41,800.00	28	2.7 0	-	1,551,198.0 0	-
中信 证券	2021 1231 0002 8118	泰格医药	2021- 12-31	319,5 00.00	2,500.00	28	2.7 0	-	319,500.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8120	宋城演艺	2021- 12-31	105,9 68.00	7,400.00	28	3.3 0	-	105,968.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8122	三环集团	2021- 12-31	227,4 60.00	5,100.00	28	2.6 0	-	227,460.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 8124	阳光电源	2021- 12-31	1,006 ,020. 00	6,900.00	28	3.1 0	-	1,006,020.0 0	-
中信 证券	2021 1231 0002 8126	华大基因	2021- 12-31	482,9 00.00	5,500.00	28	2.8 0	-	482,900.00	-
中信	2021	英科医	2021-	312,3	5,400.00	28	3.2	-	312,336.00	-

证券	1231 0002 8128	疗	12-31	36.00			0			
中信 证券	2021 1231 0002 9190	华大基 因	2021- 12-31	482,9 00.00	5,500.00	28	2.8 0	-	482,900.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9192	英科医 疗	2021- 12-31	312,3 36.00	5,400.00	28	3.2 0	-	312,336.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9194	欧普康 视	2021- 12-31	137,6 88.00	2,400.00	28	3.0 0	-	137,688.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9196	康泰生 物	2021- 12-31	187,2 26.00	1,900.00	28	2.8 0	-	187,226.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9198	芒果超 媒	2021- 12-31	755,3 04.00	13,200.00	28	3.3 0	-	755,304.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9200	蓝思科 技	2021- 12-31	160,8 60.00	7,000.00	28	2.0 0	-	160,860.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9202	亿联网 络	2021- 12-31	105,8 85.00	1,300.00	28	3.1 0	-	105,885.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9204	贝达药 业	2021- 12-31	87,81 3.00	1,100.00	28	2.9 0	-	87,813.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9206	泰格医 药	2021- 12-31	319,5 00.00	2,500.00	28	2.7 0	-	319,500.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9208	先导智 能	2021- 12-31	327,2 28.00	4,400.00	28	3.1 0	-	327,228.00	-
中信 证券	2021 1231	健帆生 物	2021- 12-31	101,2 70.00	1,900.00	28	3.2 0	-	101,270.00	-

	0002 9210									
中信 证券	2021 1231 0002 9212	温氏股 份	2021- 12-31	402,5 34.00	20,900.00	28	3.2 0	-	402,534.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9214	三环集 团	2021- 12-31	227,4 60.00	5,100.00	28	2.6 0	-	227,460.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9216	澜起科 技	2021- 12-31	1,107 ,084. 00	13,200.00	28	2.4 0	-	1,107,084.0 0	-
中信 证券	2021 1231 0002 9218	中国通 号	2021- 12-31	98,60 4.00	19,800.00	28	2.1 0	-	98,604.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9220	沪硅产 业	2021- 12-31	315,0 04.00	12,200.00	28	2.7 0	-	315,004.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9222	东方财 富	2021- 12-31	1,551 ,198. 00	41,800.00	28	2.7 0	-	1,551,198.0 0	-
中信 证券	2021 1231 0002 9224	智飞生 物	2021- 12-31	473,4 80.00	3,800.00	28	2.3 0	-	473,480.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9226	同花顺	2021- 12-31	144,5 80.00	1,000.00	28	3.2 0	-	144,580.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9228	爱尔眼 科	2021- 12-31	536,9 56.00	12,700.00	28	3.1 0	-	536,956.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9230	宋城演 艺	2021- 12-31	105,9 68.00	7,400.00	28	3.3 0	-	105,968.00	-
中信 证券	2021 1231 0002	阳光电 源	2021- 12-31	1,006 ,020. 00	6,900.00	28	3.1 0	-	1,006,020.0 0	-

	9232									
中信 证券	2021 1231 0002 9234	汇川技 术	2021- 12-31	500,7 80.00	7,300.00	28	2.6 0	-	500,780.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9236	沃森生 物	2021- 12-31	410,2 60.00	7,300.00	28	3.2 0	-	410,260.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9238	亿纬锂 能	2021- 12-31	2,339 ,964. 00	19,800.00	28	3.0 0	-	2,339,964.0 0	-
中信 证券	2021 1231 0002 9240	乐普医 疗	2021- 12-31	448,0 74.00	19,800.00	28	2.9 0	-	448,074.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9242	沪硅产 业	2021- 12-31	315,0 04.00	12,200.00	28	2.7 0	-	315,004.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9244	中国通 号	2021- 12-31	98,60 4.00	19,800.00	28	2.1 0	-	98,604.00	-
中信 证券	2021 1231 0002 9246	澜起科 技	2021- 12-31	1,107 ,084. 00	13,200.00	28	2.4 0	-	1,107,084.0 0	-
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日										
关联 方名 称	合约 编号	证券名 称	成 交 时间	交易 金额	交易数量 (单位: 股)	出借期 限(单 位: 天)	费 率 (%)	利息 收入	期末证券出 借业务余额	期末 应收 利息 余额
中信 证券	2020 0107 0000 1400	蓝思科 技	2020- 01-07	2,540 ,800. 00	160,000.0 0	14	1.7 0	1,679 .75	-	-
中信 证券	2020 0114 0000 0732	同花顺	2020- 01-14	1,662 ,750. 00	15,000.00	14	1.7 0	1,570 .37	-	-
中信 证券	2020 0121	蓝思科 技	2020- 01-21	3,227 ,200.	160,000.0 0	14	1.7 0	2,133 .54	-	-

	0000 0412			00						
中信 证券	2020 0401 0000 0430	网宿科 技	2020- 04-01	326,0 94.00	41,700.00	28	1.8 0	456.5 3	-	-
中信 证券	2020 0401 0000 0439	机器人	2020- 04-01	374,8 08.00	27,600.00	14	1.7 0	247.7 9	-	-
中信 证券	2020 0401 0000 0452	同花顺	2020- 04-01	3,971 ,565. 00	36,500.00	14	1.7 0	2,625 .65	-	-
中信 证券	2020 0401 0000 3469	同花顺	2020- 04-01	31,02 5.00	-	14	1.7 0	-	-	-
中信 证券	2020 0402 0000 0744	机器人	2020- 04-02	184,4 71.00	13,300.00	14	1.7 0	121.9 6	-	-
中信 证券	2020 0402 0000 0746	机器人	2020- 04-02	259,3 69.00	18,700.00	28	1.8 0	363.1 2	-	-
中信 证券	2020 0414 0000 0328	蓝思科 技	2020- 04-14	316,6 00.00	20,000.00	28	1.8 0	443.2 4	-	-
中信 证券	2020 0415 0000 2977	同花顺	2020- 04-15	4,256 ,630. 00	36,500.00	14	1.7 0	2,814 .11	-	-
中信 证券	2020 0421 0000 0950	沃森生 物	2020- 04-21	377,0 00.00	10,000.00	14	1.7 0	267.0 4	-	-
中信 证券	2020 0429 0000 4226	同花顺	2020- 04-29	4,157 ,715. 00	36,500.00	14	1.7 0	2,748 .71	-	-
中信 证券	2020 0429 0000	网宿科 技	2020- 04-29	322,7 58.00	41,700.00	28	1.8 0	451.8 6	-	-

	4630									
中信 证券	2020 0430 0000 0444	宋城演 艺	2020- 04-30	298,3 00.00	10,000.00	28	1.8 0	417.6 2	-	-
中信 证券	2020 0507 0000 1135	东方财 富	2020- 05-07	1,814 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,199 .26	-	-
中信 证券	2020 0507 0000 1157	汇川技 术	2020- 05-07	1,321 ,580. 00	39,100.00	14	1.7 0	873.7 1	-	-
中信 证券	2020 0507 0000 1178	沃森生 物	2020- 05-07	630,7 50.00	15,000.00	14	1.7 0	417.0 0	-	-
中信 证券	2020 0507 0000 1286	三环集 团	2020- 05-07	1,296 ,875. 00	62,500.00	14	1.7 0	857.3 8	-	-
中信 证券	2020 0513 0000 4534	同花顺	2020- 05-13	4,389 ,125. 00	36,500.00	14	1.7 0	2,901 .70	-	-
中信 证券	2020 0520 0000 7270	东方财 富	2020- 05-20	3,000 .00	-	14	1.7 0	-	-	-
中信 证券	2020 0520 0000 7339	东方财 富	2020- 05-20	-	20,000.00	14	1.7 0	-	-	-
中信 证券	2020 0527 0000 3652	同花顺	2020- 05-27	4,050 ,405. 00	36,500.00	14	1.7 0	2,677 .77	-	-
中信 证券	2020 0528 0000 2351	宋城演 艺	2020- 05-28	323,6 00.00	10,000.00	28	1.8 0	517.7 6	-	-
中信 证券	2020 0609 0000 0426	东方财 富	2020- 06-09	314,4 00.00	20,000.00	14	1.7 0	207.8 5	-	-

中信 证券	2020 0609 0000 0495	亿联网络	2020- 06-09	937,3 50.00	15,000.00	28	1.8 0	1,312 .29	-	-
中信 证券	2020 0610 0000 2950	同花顺	2020- 06-10	4,299 ,700. 00	36,500.00	14	1.7 0	2,842 .58	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 5509	乐普医疗	2020- 06-17	644,3 50.00	17,500.00	28	1.8 0	902.0 9	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 5558	亿纬锂能	2020- 06-17	550,1 60.00	13,000.00	28	1.8 0	770.2 2	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 5562	爱尔眼科	2020- 06-17	1,217 ,556. 00	27,900.00	28	1.8 0	1,704 .58	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 5609	同花顺	2020- 06-17	1,189 ,000. 00	10,000.00	28	1.8 0	1,664 .60	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 5620	东方财富	2020- 06-17	1,494 ,220. 00	91,000.00	28	1.8 0	2,091 .91	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 5725	智飞生物	2020- 06-17	951,9 00.00	10,000.00	28	1.8 0	1,332 .66	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 5732	汇川技术	2020- 06-17	481,6 24.00	14,300.00	28	1.8 0	674.2 7	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 5759	信维通信	2020- 06-17	484,7 44.00	10,400.00	28	1.8 0	678.6 4	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 5761	沃森生物	2020- 06-17	1,154 ,530. 00	21,400.00	28	1.8 0	1,616 .34	-	-
中信	2020	宋城演	2020-	401,7	22,100.00	28	1.8	562.4	-	-

证券	0617 0000 5764	艺	06-17	78.00			0	9		
中信 证券	2020 0617 0000 6027	泰格医 药	2020- 06-17	855,0 00.00	10,000.00	28	1.8 0	1,197 .00	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 6044	芒果超 媒	2020- 06-17	626,4 00.00	10,000.00	28	1.8 0	876.9 6	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 6045	三环集 团	2020- 06-17	303,4 46.00	14,300.00	28	1.8 0	424.8 2	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 6067	蓝思科 技	2020- 06-17	399,4 90.00	18,200.00	28	1.8 0	559.2 9	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 6135	温氏股 份	2020- 06-17	1,326 ,150. 00	63,000.00	28	1.8 0	1,856 .61	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 6172	康泰生 物	2020- 06-17	1,473 ,000. 00	10,000.00	28	1.8 0	2,062 .20	-	-
中信 证券	2020 0617 0000 6192	亿联网 络	2020- 06-17	648,0 00.00	10,000.00	28	1.8 0	907.2 0	-	-
中信 证券	2020 0622 0001 3364	信维通 信	2020- 06-22	520.0 0	-	28	1.8 0	-	-	-
中信 证券	2020 0623 0000 0400	东方财 富	2020- 06-23	1,961 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,296 .44	-	-
中信 证券	2020 0629 0000 3598	宋城演 艺	2020- 06-29	175,5 00.00	10,000.00	28	1.8 0	245.7 0	-	-
中信 证券	2020 0630	蓝思科 技	2020- 06-30	4,695 .60	-	28	1.8 0	-	-	-

	0000 9553									
中信 证券	2020 0702 0000 0472	东方财 富	2020- 07-02	2,190 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,447 .83	-	-
中信 证券	2020 0707 0000 0900	东方财 富	2020- 07-07	4,716 ,000. 00	200,000.0 0	28	1.8 0	6,602 .40	-	-
中信 证券	2020 0707 0000 3762	东方财 富	2020- 07-07	2,358 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,558 .90	-	-
中信 证券	2020 0714 0000 0476	智飞生 物	2020- 07-14	1,474 ,440. 00	11,000.00	14	1.7 0	974.7 7	-	-
中信 证券	2020 0714 0000 0490	汇川技 术	2020- 07-14	1,506 ,000. 00	30,000.00	14	1.7 0	995.6 3	-	-
中信 证券	2020 0714 0000 0546	蓝思科 技	2020- 07-14	1,490 ,720. 00	44,000.00	14	1.7 0	985.5 3	-	-
中信 证券	2020 0714 0000 0580	康泰生 物	2020- 07-14	2,005 ,200. 00	10,000.00	14	1.7 0	1,325 .66	-	-
中信 证券	2020 0714 0001 2453	汇川技 术	2020- 07-14	2,574 .00	-	28	1.8 0	-	-	-
中信 证券	2020 0714 0001 2503	汇川技 术	2020- 07-14	5,400 .00	-	14	1.7 0	-	-	-
中信 证券	2020 0716 0000 1442	东方财 富	2020- 07-16	2,528 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,671 .29	-	-
中信 证券	2020 0721 0000	东方财 富	2020- 07-21	2,586 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,709 .63	-	-

	3359									
中信 证券	2020 0728 0000 0580	亿纬锂 能	2020- 07-28	8,058 ,500. 00	142,000.0 0	28	1.8 0	11,28 1.90	-	-
中信 证券	2020 0728 0000 3613	智飞生 物	2020- 07-28	1,765 ,500. 00	11,000.00	14	1.7 0	1,167 .19	-	-
中信 证券	2020 0728 0000 3943	蓝思科 技	2020- 07-28	1,304 ,600. 00	44,000.00	14	1.7 0	862.4 9	-	-
中信 证券	2020 0730 0000 3806	东方财 富	2020- 07-30	2,611 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,726 .16	-	-
中信 证券	2020 0804 0000 0508	沃森生 物	2020- 08-04	8,345 ,000. 00	100,000.0 0	28	1.8 0	11,68 3.00	-	-
中信 证券	2020 0804 0000 0545	蓝思科 技	2020- 08-04	500,1 00.00	15,000.00	14	1.7 0	330.6 2	-	-
中信 证券	2020 0804 0000 2529	东方财 富	2020- 08-04	5,442 ,000. 00	200,000.0 0	28	1.8 0	7,618 .80	-	-
中信 证券	2020 0804 0000 2531	东方财 富	2020- 08-04	2,721 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,798 .88	-	-
中信 证券	2020 0811 0000 0496	亿纬锂 能	2020- 08-11	1,215 ,984. 00	23,100.00	28	1.8 0	1,702 .38	-	-
中信 证券	2020 0811 0000 0524	东方财 富	2020- 08-11	2,519 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,665 .34	-	-
中信 证券	2020 0811 0000 0546	宋城演 艺	2020- 08-11	750,2 22.00	42,100.00	28	1.8 0	1,050 .31	-	-

中信 证券	2020 0811 0000 5503	智飞生 物	2020- 08-11	1,735 ,800. 00	11,000.00	14	1.7 0	1,147 .56	-	-
中信 证券	2020 0811 0001 0309	智飞生 物	2020- 08-11	5,500 .00	-	14	1.7 0	-	-	-
中信 证券	2020 0813 0000 2531	东方财 富	2020- 08-13	2,491 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,646 .83	-	-
中信 证券	2020 0818 0000 2587	蓝思科 技	2020- 08-18	464,5 50.00	15,000.00	14	1.7 0	307.1 2	-	-
中信 证券	2020 0818 0000 3547	东方财 富	2020- 08-18	2,619 ,000. 00	100,000.0 0	14	1.7 0	1,731 .45	-	-
中信 证券	2020 0824 0000 0343	乐普医 疗	2020- 08-24	384,6 00.00	10,000.00	28	3.1 0	927.3 1	-	-
中信 证券	2020 0824 0000 0345	爱尔眼 科	2020- 08-24	462,0 00.00	10,000.00	28	3.1 0	1,113 .93	-	-
中信 证券	2020 0824 0000 0347	东方财 富	2020- 08-24	681,9 59.00	26,300.00	28	3.1 0	1,644 .28	-	-
中信 证券	2020 0824 0000 0349	汇川技 术	2020- 08-24	560,6 00.00	10,000.00	28	3.1 0	1,351 .67	-	-
中信 证券	2020 0824 0000 0351	沃森生 物	2020- 08-24	951,3 00.00	15,100.00	28	3.1 0	2,293 .69	-	-
中信 证券	2020 0824 0000 0353	宋城演 艺	2020- 08-24	1,018 ,753. 00	55,700.00	28	3.1 0	2,456 .33	-	-
中信	2020	三环集	2020-	279,0	10,000.00	28	3.1	672.7	-	-

证券	0824 0000 0355	团	08-24	00.00			0	0		
中信 证券	2020 0824 0000 0357	温氏股 份	2020- 08-24	450,1 80.00	18,300.00	28	3.1 0	1,085 .43	-	-
中信 证券	2020 0824 0000 0369	蓝思科 技	2020- 08-24	354,2 00.00	10,000.00	28	4.0 0	1,101 .96	-	-
中信 证券	2020 0825 0000 8037	亿纬锂 能	2020- 08-25	7,650 ,960. 00	142,000.0 0	28	1.8 0	10,71 1.34	-	-
中信 证券	2020 0827 0000 0467	温氏股 份	2020- 08-27	10,81 0,000 .00	460,000.0 0	28	3.1 0	26,06 4.11	-	-
中信 证券	2020 0901 0000 4445	沃森生 物	2020- 09-01	6,195 ,000. 00	100,000.0 0	28	3.1 0	14,93 6.83	-	-
中信 证券	2020 0901 0000 4447	蓝思科 技	2020- 09-01	544,9 50.00	15,000.00	14	3.2 0	678.1 6	-	-
中信 证券	2020 0901 0000 4449	东方财 富	2020- 09-01	5,258 ,000. 00	200,000.0 0	28	4.4 0	17,99 4.04	-	-
中信 证券	2020 0901 0000 4451	东方财 富	2020- 09-01	2,629 ,000. 00	100,000.0 0	14	4.4 0	4,498 .51	-	-
中信 证券	2020 0903 0000 0439	东方财 富	2020- 09-03	2,685 ,660. 00	102,000.0 0	14	5.0 0	5,222 .12	-	-
中信 证券	2020 0903 0000 0451	沃森生 物	2020- 09-03	2,545 ,620. 00	42,000.00	28	3.3 0	8,400 .55	-	-
中信 证券	2020 0908	宋城演 艺	2020- 09-08	389,5 80.00	21,500.00	28	3.2 0	1,073 .51	-	-

	0000 0399									
中信 证券	2020 0910 0000 0526	东方财 富	2020- 09-10	1,895 ,440. 00	81,700.00	28	4.6 0	7,023 .66	-	-
中信 证券	2020 0915 0000 3908	东方财 富	2020- 09-15	2,371 ,000. 00	100,000.0 0	14	4.7 0	4,333 .66	-	-
中信 证券	2020 0915 0000 3910	蓝思科 技	2020- 09-15	514,2 00.00	15,000.00	14	4.3 0	859.8 6	-	-
中信 证券	2020 0921 0000 7316	乐普医 疗	2020- 09-21	334,6 00.00	10,000.00	28	3.4 0	884.8 3	-	-
中信 证券	2020 0921 0000 7318	爱尔眼 科	2020- 09-21	471,6 00.00	10,000.00	28	3.3 0	1,210 .44	-	-
中信 证券	2020 0921 0000 7320	沃森生 物	2020- 09-21	814,6 45.00	15,100.00	28	3.4 0	2,154 .28	-	-
中信 证券	2020 0921 0000 7322	宋城演 艺	2020- 09-21	1,015 ,411. 00	55,700.00	28	3.6 0	2,843 .15	-	-
中信 证券	2020 0921 0000 7324	东方财 富	2020- 09-21	643,0 35.00	26,300.00	28	3.7 0	1,850 .51	-	-
中信 证券	2020 0921 0000 7326	汇川技 术	2020- 09-21	558,3 00.00	10,000.00	28	3.3 0	1,432 .97	-	-
中信 证券	2020 0921 0000 7328	三环集 团	2020- 09-21	280,4 00.00	10,000.00	28	3.2 0	697.8 8	-	-
中信 证券	2020 0921 0000	蓝思科 技	2020- 09-21	332,5 00.00	10,000.00	28	4.1 0	1,060 .31	-	-

	7330									
中信 证券	2020 0921 0000 7332	温氏股 份	2020- 09-21	384,8 49.00	18,300.00	28	3.8 0	1,137 .44	-	-
中信 证券	2020 0922 0000 6921	亿纬锂 能	2020- 09-22	6,833 ,040. 00	142,000.0 0	28	3.4 0	18,06 9.59	-	-
中信 证券	2020 0924 0000 0320	智飞生 物	2020- 09-24	1,426 ,000. 00	10,000.00	28	3.2 0	3,549 .16	-	-
中信 证券	2020 0924 0000 0334	沃森生 物	2020- 09-24	991,6 20.00	18,000.00	28	3.2 0	2,468 .03	-	-
中信 证券	2020 0924 0000 0338	爱尔眼 科	2020- 09-24	2,398 ,110. 00	50,700.00	14	3.2 0	3,197 .48	-	-
中信 证券	2020 0924 0000 3706	温氏股 份	2020- 09-24	9,370 ,200. 00	460,000.0 0	28	3.8 0	27,69 4.15	-	-
中信 证券	2020 0929 0000 5023	蓝思科 技	2020- 09-29	484,6 50.00	15,000.00	14	4.1 0	772.7 5	-	-
中信 证券	2020 0929 0000 5047	东方财 富	2020- 09-29	2,421 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.5 0	3,295 .25	-	-
中信 证券	2020 0929 0000 5268	沃森生 物	2020- 09-03	840.0 0	-	28	3.3 0	-	-	-
中信 证券	2020 0929 0000 5327	沃森生 物	2020- 09-21	302.0 0	-	28	3.4 0	-	-	-
中信 证券	2020 0929 0000 5356	沃森生 物	2020- 09-24	360.0 0	-	28	3.2 0	-	-	-

中信 证券	2020 1009 0003 3275	宋城演 艺	2020- 10-09	375,6 05.00	21,500.00	28	3.5 0	1,022 .48	-	-
中信 证券	2020 1009 0003 3281	沃森生 物	2020- 10-09	2,202 ,480. 00	42,000.00	28	3.2 0	5,481 .73	-	-
中信 证券	2020 1009 0003 3287	东方财 富	2020- 10-09	2,011 ,454. 00	81,700.00	28	3.4 0	5,319 .18	-	-
中信 证券	2020 1013 0000 0711	蓝思科 技	2020- 10-13	2,164 ,200. 00	60,000.00	14	3.5 0	2,945 .72	-	-
中信 证券	2020 1013 0000 7494	东方财 富	2020- 10-13	2,612 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.4 0	3,453 .64	-	-
中信 证券	2020 1013 0000 7500	蓝思科 技	2020- 10-13	541,0 50.00	15,000.00	14	4.4 0	925.8 0	-	-
中信 证券	2020 1015 0000 0548	同花顺	2020- 10-15	2,318 ,550. 00	14,500.00	14	3.4 0	3,065 .64	-	-
中信 证券	2020 1015 0000 0636	蓝思科 技	2020- 10-15	354,2 00.00	10,000.00	28	3.4 0	936.6 6	-	-
中信 证券	2020 1019 0000 4513	温氏股 份	2020- 10-19	361,2 42.00	18,300.00	28	3.2 0	899.0 9	-	-
中信 证券	2020 1019 0000 4515	乐普医 疗	2020- 10-19	312,8 00.00	10,000.00	28	3.4 0	827.1 8	-	-
中信 证券	2020 1019 0000 4721	汇川技 术	2020- 10-19	625,7 00.00	10,000.00	28	3.3 0	1,605 .96	-	-
中信	2020	爱尔眼	2020-	562,1	10,000.00	28	3.4	1,486	-	-

证券	1019 0000 4723	科	10-19	00.00			0	.44		
中信 证券	2020 1019 0000 4725	东方财 富	2020- 10-19	683,0 11.00	26,300.00	28	3.2 0	1,699 .94	-	-
中信 证券	2020 1019 0000 4727	蓝思科 技	2020- 10-19	349,1 00.00	10,000.00	28	3.4 0	923.1 8	-	-
中信 证券	2020 1019 0000 4729	沃森生 物	2020- 10-19	854,6 60.00	15,100.00	28	3.4 0	2,260 .10	-	-
中信 证券	2020 1019 0000 4731	三环集 团	2020- 10-19	289,6 00.00	10,000.00	28	3.4 0	765.8 3	-	-
中信 证券	2020 1019 0000 4733	宋城演 艺	2020- 10-19	915,7 08.00	55,700.00	28	3.4 0	2,421 .54	-	-
中信 证券	2020 1020 0000 3929	亿纬锂 能	2020- 10-20	7,947 ,740. 00	142,000.0 0	28	3.2 0	19,78 1.04	-	-
中信 证券	2020 1022 0000 0503	东方财 富	2020- 10-22	3,913 ,500. 00	150,000.0 0	28	3.3 0	10,04 4.65	-	-
中信 证券	2020 1022 0000 3599	智飞生 物	2020- 10-22	1,530 ,100. 00	10,000.00	28	3.4 0	4,046 .26	-	-
中信 证券	2020 1022 0000 3601	温氏股 份	2020- 10-22	8,804 ,400. 00	460,000.0 0	28	3.2 0	21,91 3.17	-	-
中信 证券	2020 1027 0000 9152	东方财 富	2020- 10-27	2,433 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.4 0	3,216 .97	-	-
中信 证券	2020 1027	蓝思科 技	2020- 10-27	513,4 50.00	15,000.00	14	4.6 0	918.5 1	-	-

	0000 9154									
中信 证券	2020 1027 0000 9156	蓝思科 技	2020- 10-27	2,053 ,800. 00	60,000.00	14	4.6 0	3,674 .02	-	-
中信 证券	2020 1029 0000 0275	亿纬锂 能	2020- 10-29	535,5 00.00	10,000.00	14	3.4 0	708.0 5	-	-
中信 证券	2020 1029 0000 0279	宋城演 艺	2020- 10-29	160,1 00.00	10,000.00	14	3.3 0	205.4 6	-	-
中信 证券	2020 1029 0000 0283	亿联网 络	2020- 10-29	627,3 00.00	10,000.00	14	3.4 0	829.4 3	-	-
中信 证券	2020 1103 0000 0254	东方财 富	2020- 11-03	5,195 ,340. 00	213,800.0 0	28	3.2 0	12,93 0.62	-	-
中信 证券	2020 1103 0000 0256	亿联网 络	2020- 11-03	1,031 ,454. 00	16,200.00	28	3.4 0	2,727 .62	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0175	乐普医 疗	2020- 11-04	458,9 34.00	14,700.00	28	3.5 0	1,249 .32	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0177	芒果超 媒	2020- 11-04	795,0 00.00	10,000.00	28	3.9 0	2,411 .50	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0179	蓝思科 技	2020- 11-04	548,6 25.00	16,500.00	28	5.8 0	2,474 .91	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0181	泰格医 药	2020- 11-04	1,255 ,000. 00	10,000.00	28	3.4 0	3,318 .78	-	-
中信 证券	2020 1104 0000	三环集 团	2020- 11-04	533,9 52.00	16,200.00	28	3.6 0	1,495 .07	-	-

	0183									
中信 证券	2020 1104 0000 0185	温氏股 份	2020- 11-04	985,3 32.00	52,300.00	28	3.3 0	2,529 .02	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0187	东方财 富	2020- 11-04	2,305 ,744. 00	95,200.00	28	3.2 0	5,738 .74	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0189	智飞生 物	2020- 11-04	2,240 ,325. 00	13,500.00	28	3.7 0	6,447 .16	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0191	亿纬锂 能	2020- 11-04	606,3 20.00	10,600.00	28	3.3 0	1,556 .22	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0193	爱尔眼 科	2020- 11-04	1,552 ,500. 00	23,000.00	28	3.7 0	4,467 .75	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0195	沃森生 物	2020- 11-04	1,357 ,983. 00	26,100.00	28	3.8 0	4,013 .59	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0197	宋城演 艺	2020- 11-04	288,7 88.00	17,200.00	28	3.4 0	763.6 8	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0199	汇川技 术	2020- 11-04	955,9 00.00	12,100.00	28	3.5 0	2,602 .17	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 0201	信维通 信	2020- 11-04	481,5 00.00	10,000.00	28	3.2 0	1,198 .40	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 3264	温氏股 份	2020- 10-19	5,490 .00	-	28	3.2 0	-	-	-
中信 证券	2020 1104 0000 3286	温氏股 份	2020- 10-22	138,0 00.00	-	28	3.2 0	-	-	-

中信 证券	2020 1104 0000 3371	温氏股 份	2020- 11-04	15,69 0.00	-	28	3.3 0	-	-	-
中信 证券	2020 1106 0002 7303	东方财 富	2020- 11-06	2,058 ,840. 00	81,700.00	28	3.2 0	5,124 .22	-	-
中信 证券	2020 1106 0002 8305	沃森生 物	2020- 11-06	2,049 ,600. 00	42,000.00	28	3.3 0	5,260 .64	-	-
中信 证券	2020 1106 0002 8311	宋城演 艺	2020- 11-06	361,2 00.00	21,500.00	28	3.2 0	898.9 9	-	-
中信 证券	2020 1110 0000 9023	蓝思科 技	2020- 11-10	2,013 ,600. 00	60,000.00	14	5.9 0	4,620 .09	-	-
中信 证券	2020 1110 0000 9039	蓝思科 技	2020- 11-10	503,4 00.00	15,000.00	14	5.9 0	1,155 .02	-	-
中信 证券	2020 1110 0000 9041	东方财 富	2020- 11-10	2,667 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.3 0	3,422 .65	-	-
中信 证券	2020 1112 0000 0718	温氏股 份	2020- 11-12	1,164 ,375. 00	62,500.00	14	3.5 0	1,584 .84	-	-
中信 证券	2020 1112 0000 0722	亿纬锂 能	2020- 11-12	1,018 ,080. 00	16,000.00	14	3.4 0	1,346 .13	-	-
中信 证券	2020 1112 0000 0726	智飞生 物	2020- 11-12	4,050 ,000. 00	30,000.00	14	3.5 0	5,512 .50	-	-
中信 证券	2020 1112 0000 4281	亿纬锂 能	2020- 11-12	636,3 00.00	10,000.00	14	3.4 0	841.3 3	-	-
中信	2020	蓝思科	2020-	329,9	10,000.00	28	5.8	1,488	-	-

证券	1112 0000 4283	技	11-12	00.00			0	.22		
中信 证券	2020 1116 0000 5316	宋城演 艺	2020- 11-16	1,019 ,310. 00	55,700.00	28	3.4 0	2,695 .51	-	-
中信 证券	2020 1116 0000 5318	沃森生 物	2020- 11-16	698,2 24.00	15,100.00	28	3.6 0	1,955 .03	-	-
中信 证券	2020 1116 0000 5320	汇川技 术	2020- 11-16	826,4 00.00	10,000.00	28	3.4 0	2,185 .37	-	-
中信 证券	2020 1116 0000 5322	爱尔眼 科	2020- 11-16	690,9 00.00	10,000.00	28	3.4 0	1,827 .05	-	-
中信 证券	2020 1116 0000 5324	乐普医 疗	2020- 11-16	309,2 00.00	10,000.00	28	3.4 0	817.6 6	-	-
中信 证券	2020 1116 0000 5326	东方财 富	2020- 11-16	662,2 34.00	26,300.00	28	3.3 0	1,699 .73	-	-
中信 证券	2020 1116 0000 5328	三环集 团	2020- 11-16	338,4 00.00	10,000.00	28	3.4 0	894.8 8	-	-
中信 证券	2020 1116 0000 5330	蓝思科 技	2020- 11-16	303,8 00.00	10,000.00	28	4.4 0	1,039 .67	-	-
中信 证券	2020 1116 0000 5332	温氏股 份	2020- 11-16	351,7 26.00	18,300.00	28	3.4 0	930.1 2	-	-
中信 证券	2020 1117 0000 0385	乐普医 疗	2020- 11-17	538,3 80.00	18,000.00	14	4.0 0	837.4 8	-	-
中信 证券	2020 1117	乐普医 疗	2020- 11-17	646,0 56.00	21,600.00	14	4.0 0	1,004 .98	-	-

	0000 0389									
中信 证券	2020 1117 0000 6111	亿纬锂 能	2020- 11-17	9,062 ,440. 00	142,000.0 0	28	3.3 0	23,26 0.26	-	-
中信 证券	2020 1119 0000 0417	温氏股 份	2020- 11-19	1,580 ,800. 00	80,000.00	14	3.8 0	2,336 .07	-	-
中信 证券	2020 1119 0000 4402	温氏股 份	2020- 11-19	9,089 ,600. 00	460,000.0 0	28	3.4 0	24,03 6.94	-	-
中信 证券	2020 1119 0000 4422	东方财 富	2020- 11-19	3,874 ,500. 00	150,000.0 0	28	3.3 0	9,944 .55	-	-
中信 证券	2020 1124 0000 7622	蓝思科 技	2020- 11-24	458,5 50.00	15,000.00	14	4.8 0	855.9 6	-	-
中信 证券	2020 1124 0000 8622	蓝思科 技	2020- 11-24	1,834 ,200. 00	60,000.00	14	4.8 0	3,423 .84	-	-
中信 证券	2020 1126 0000 2650	亿纬锂 能	2020- 11-26	1,052 ,160. 00	16,000.00	14	3.5 0	1,432 .11	-	-
中信 证券	2020 1201 0000 2799	亿联网 络	2020- 12-01	1,205 ,280. 00	16,200.00	28	4.0 0	3,749 .76	-	-
中信 证券	2020 1201 0000 2801	东方财 富	2020- 12-01	6,289 ,996. 00	213,800.0 0	28	3.4 0	16,63 3.54	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2566	芒果超 媒	2020- 12-02	661,1 00.00	10,000.00	28	3.6 0	1,851 .08	-	-
中信 证券	2020 1202 0000	乐普医 疗	2020- 12-02	436,1 49.00	14,700.00	28	3.7 0	1,255 .14	-	-

	2568									
中信 证券	2020 1202 0000 2572	蓝思科 技	2020- 12-02	540,3 75.00	16,500.00	28	4.0 0	1,681 .17	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2574	信维通 信	2020- 12-02	465,0 00.00	10,000.00	28	3.7 0	1,338 .17	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2576	汇川技 术	2020- 12-02	983,8 51.00	12,100.00	28	3.5 0	2,678 .26	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2578	宋城演 艺	2020- 12-02	319,7 48.00	17,200.00	28	4.0 0	994.7 7	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2582	沃森生 物	2020- 12-02	1,119 ,429. 00	26,100.00	28	3.7 0	3,221 .47	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2584	温氏股 份	2020- 12-02	1,023 ,511. 00	52,300.00	28	3.4 0	2,706 .62	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2586	泰格医 药	2020- 12-02	1,190 ,200. 00	10,000.00	28	3.4 0	3,147 .42	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2588	东方财 富	2020- 12-02	2,729 ,384. 00	95,200.00	28	3.4 0	7,217 .70	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2590	三环集 团	2020- 12-02	542,8 62.00	16,200.00	28	3.5 0	1,477 .79	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2592	爱尔眼 科	2020- 12-02	1,473 ,150. 00	23,000.00	28	3.5 0	4,010 .24	-	-
中信 证券	2020 1202 0000 2594	亿纬锂 能	2020- 12-02	659,1 08.00	10,600.00	28	3.5 0	1,794 .24	-	-

中信 证券	2020 1202 0000 2596	智飞生 物	2020- 12-02	1,729 ,080. 00	13,500.00	28	3.7 0	4,975 .91	-	-
中信 证券	2020 1203 0000 0428	东方财 富	2020- 12-03	2,920 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.2 0	3,633 .78	-	-
中信 证券	2020 1203 0000 0440	泰格医 药	2020- 12-03	1,348 ,600. 00	11,000.00	28	3.4 0	3,566 .30	-	-
中信 证券	2020 1203 0000 0448	沃森生 物	2020- 12-03	2,265 ,000. 00	50,000.00	28	3.5 0	6,165 .83	-	-
中信 证券	2020 1203 0000 3710	温氏股 份	2020- 12-03	1,566 ,400. 00	80,000.00	14	3.5 0	2,132 .04	-	-
中信 证券	2020 1204 0000 5278	沃森生 物	2020- 12-04	1,917 ,720. 00	42,000.00	28	3.7 0	4,984 .70	-	4,984 .70
中信 证券	2020 1204 0000 5280	宋城演 艺	2020- 12-04	401,4 05.00	21,500.00	28	4.0 0	1,127 .97	-	1,127 .97
中信 证券	2020 1204 0000 5282	东方财 富	2020- 12-04	2,317 ,012. 00	81,700.00	28	3.4 0	5,534 .25	-	5,534 .25
中信 证券	2020 1208 0000 0426	温氏股 份	2020- 12-08	1,884 ,800. 00	95,000.00	28	3.2 0	3,853 .37	1,731,850.0 0	3,853 .37
中信 证券	2020 1208 0000 0432	芒果超 媒	2020- 12-08	1,319 ,000. 00	20,000.00	28	1.9 0	1,601 .12	1,450,000.0 0	1,601 .12
中信 证券	2020 1208 0000 4916	蓝思科 技	2020- 12-08	497,2 50.00	15,000.00	14	3.6 0	696.1 5	-	-
中信	2020	蓝思科	2020-	1,989	60,000.00	14	3.6	2,784	-	-

证券	1208 0000 4920	技	12-08	,000. 00			0	.60		
中信 证券	2020 1210 0000 3508	蓝思科 技	2020- 12-10	331,0 00.00	10,000.00	28	3.5 0	675.8 0	306,100.00	675.8 0
中信 证券	2020 1210 0000 3516	亿纬锂 能	2020- 12-10	1,056 ,320. 00	16,000.00	14	3.6 0	1,478 .85	-	-
中信 证券	2020 1214 0000 7715	三环集 团	2020- 12-14	335,0 00.00	10,000.00	28	4.4 0	696.0 5	372,500.00	696.0 5
中信 证券	2020 1214 0000 7889	宋城演 艺	2020- 12-14	995,9 16.00	55,700.00	28	3.4 0	1,599 .00	987,004.00	1,599 .00
中信 证券	2020 1214 0000 7891	汇川技 术	2020- 12-14	841,9 00.00	10,000.00	28	3.4 0	1,351 .72	933,000.00	1,351 .72
中信 证券	2020 1214 0000 7893	沃森生 物	2020- 12-14	529,7 08.00	15,100.00	28	3.3 0	825.4 6	582,256.00	825.4 6
中信 证券	2020 1214 0000 7895	蓝思科 技	2020- 12-14	306,4 00.00	10,000.00	28	3.5 0	506.4 1	306,100.00	506.4 1
中信 证券	2020 1214 0000 7897	东方财 富	2020- 12-14	699,3 17.00	26,300.00	28	3.2 0	1,056 .74	815,300.00	1,056 .74
中信 证券	2020 1214 0000 7899	爱尔眼 科	2020- 12-14	688,5 00.00	10,000.00	28	3.5 0	1,137 .94	748,900.00	1,137 .94
中信 证券	2020 1214 0000 7901	乐普医 疗	2020- 12-14	272,1 00.00	10,000.00	28	3.5 0	449.7 2	271,800.00	449.7 2
中信 证券	2020 1214	温氏股 份	2020- 12-14	357,2 16.00	18,300.00	28	3.2 0	539.7 9	333,609.00	539.7 9

	0000 7903									
中信 证券	2020 1215 0000 0583	宋城演 艺	2020- 12-15	643,6 80.00	36,000.00	28	3.4 0	972.6 7	637,920.00	972.6 7
中信 证券	2020 1215 0000 6471	亿纬锂 能	2020- 12-15	9,982 ,600. 00	142,000.0 0	28	3.5 0	15,52 8.49	11,573,000. 00	15,52 8.49
中信 证券	2020 1217 0001 0829	东方财 富	2020- 12-17	4,096 ,500. 00	150,000.0 0	28	3.2 0	5,097 .87	4,650,000.0 0	5,097 .87
中信 证券	2020 1217 0001 0831	东方财 富	2020- 12-17	2,731 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.3 0	3,504 .78	-	-
中信 证券	2020 1217 0001 0833	温氏股 份	2020- 12-17	8,758 ,400. 00	460,000.0 0	28	3.2 0	10,89 9.34	8,385,800.0 0	10,89 9.34
中信 证券	2020 1222 0001 0379	蓝思科 技	2020- 12-22	1,798 ,200. 00	60,000.00	14	3.8 0	1,708 .29	1,836,600.0 0	1,708 .29
中信 证券	2020 1222 0001 0381	蓝思科 技	2020- 12-22	449,5 50.00	15,000.00	14	3.8 0	427.0 8	459,150.00	427.0 8
中信 证券	2020 1224 0000 1364	智飞生 物	2020- 12-24	1,887 ,360. 00	12,000.00	28	3.4 0	1,247 .76	1,774,920.0 0	1,247 .76
中信 证券	2020 1224 0001 3415	亿纬锂 能	2020- 12-24	1,156 ,320. 00	16,000.00	14	3.4 0	764.4 6	1,304,000.0 0	764.4 6
中信 证券	2020 1229 0000 0464	温氏股 份	2020- 12-29	333,7 76.00	18,400.00	14	3.3 0	61.19	335,432.00	61.19
中信 证券	2020 1229 0000	沃森生 物	2020- 12-29	3,836 ,000. 00	100,000.0 0	28	3.5 0	745.8 9	3,856,000.0 0	745.8 9

	0550									
中信 证券	2020 1229 0000 0560	亿纬锂 能	2020- 12-29	1,025 ,440. 00	13,600.00	14	3.5 0	199.3 9	1,108,400.0 0	199.3 9
中信 证券	2020 1229 0000 0566	智飞生 物	2020- 12-29	6,366 ,360. 00	44,000.00	28	3.6 0	1,273 .27	6,508,040.0 0	1,273 .27
中信 证券	2020 1229 0000 7127	东方财 富	2020- 12-29	5,898 ,742. 00	213,800.0 0	28	3.3 0	1,081 .44	6,627,800.0 0	1,081 .44
中信 证券	2020 1229 0000 7129	亿联网 络	2020- 12-29	1,177 ,092. 00	16,200.00	28	3.4 0	222.3 4	1,184,544.0 0	222.3 4
中信 证券	2020 1230 0000 8709	亿纬锂 能	2020- 12-30	840,0 50.00	10,600.00	28	3.3 0	77.00	863,900.00	77.00
中信 证券	2020 1230 0000 8711	信维通 信	2020- 12-30	366,2 00.00	10,000.00	28	3.9 0	39.67	358,800.00	39.67
中信 证券	2020 1230 0000 8713	汇川技 术	2020- 12-30	1,059 ,476. 00	12,100.00	28	3.3 0	97.12	1,128,930.0 0	97.12
中信 证券	2020 1230 0000 8715	智飞生 物	2020- 12-30	1,998 ,135. 00	13,500.00	28	3.4 0	188.7 1	1,996,785.0 0	188.7 1
中信 证券	2020 1230 0000 8717	蓝思科 技	2020- 12-30	502,2 60.00	16,500.00	28	3.1 0	43.25	505,065.00	43.25
中信 证券	2020 1230 0000 8719	温氏股 份	2020- 12-30	947,6 76.00	52,300.00	28	3.3 0	86.87	953,429.00	86.87
中信 证券	2020 1230 0000 8721	泰格医 药	2020- 12-30	1,633 ,500. 00	10,000.00	28	3.7 0	167.8 9	1,616,100.0 0	167.8 9

中信 证券	2020 1230 0000 8723	芒果超 媒	2020- 12-30	701,9 00.00	10,000.00	28	3.4 0	66.29	725,000.00	66.29
中信 证券	2020 1230 0000 8725	三环集 团	2020- 12-30	600,2 10.00	16,200.00	28	3.9 0	65.02	603,450.00	65.02
中信 证券	2020 1230 0000 8727	沃森生 物	2020- 12-30	999,3 69.00	26,100.00	28	3.5 0	97.16	1,006,416.0 0	97.16
中信 证券	2020 1230 0000 8729	宋城演 艺	2020- 12-30	290,3 36.00	17,200.00	28	3.3 0	26.61	304,784.00	26.61
中信 证券	2020 1230 0000 9361	乐普医 疗	2020- 12-30	397,3 41.00	14,700.00	28	3.2 0	35.32	399,546.00	35.32
中信 证券	2020 1230 0000 9363	爱尔眼 科	2020- 12-30	1,698 ,550. 00	23,000.00	28	3.1 0	146.2 6	1,722,470.0 0	146.2 6
中信 证券	2020 1231 0000 0295	沃森生 物	2020- 12-31	385,6 00.00	10,000.00	28	3.5 0	-	385,600.00	-
中信 证券	2020 1231 0000 0303	东方财 富	2020- 12-31	35,96 0,000 .00	1,160,000. 00	14	3.4 0	-	35,960,000. 00	-
中信 证券	2020 1231 0001 0596	泰格医 药	2020- 12-31	1,777 ,710. 00	11,000.00	28	3.7 0	-	1,777,710.0 0	-
中信 证券	2020 1231 0001 0598	沃森生 物	2020- 12-31	1,928 ,000. 00	50,000.00	28	3.5 0	-	1,928,000.0 0	-
中信 证券	2020 1231 0001 0600	东方财 富	2020- 12-31	3,100 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.4 0	-	3,100,000.0 0	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏沪深 300ETF 联接	2,141,945,591.00	37.19%	2,156,915,291.00	37.42%
中信证券	60,540,609.00	1.05%	86,219,751.00	1.50%

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	27,638,718.23	228,022.32	59,012,304.81	459,360.12

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	002142	宁波银行	配股发行	376,101	7,510,736.97
中信证券	600905	三峡能源	新股发行	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	601728	中国电信	新股发行	562,873	2,549,814.69
中信证券	688235	百济神州	新股发行	12,010	2,313,126.00
中信证券	688819	天能股份	新股发行	28,382	1,186,083.78

中信证券	688739	成大生物	新股发行	9,882	1,087,020.00
中信证券	688187	时代电气	新股发行	33,865	1,062,683.70
中信证券	688176	亚虹医药	新股发行	37,990	873,010.20
中信证券	688192	迪哲医药	新股发行	8,926	469,329.08
中信证券	688211	中科微至	新股发行	4,501	405,990.20
中信证券	688660	电气风电	新股发行	51,238	278,734.72
中信证券	688798	艾为电子	新股发行	3,592	275,075.36
中信证券	688779	长远锂科	新股发行	43,086	243,435.90
中信证券	601825	沪农商行	新股发行	15,480	137,772.00
中信证券	688670	金迪克	新股发行	2,310	127,465.80
中信证券	688276	百克生物	新股发行	3,486	126,716.10
中信证券	688212	澳华内镜	新股发行	3,496	78,660.00
中信证券	688776	国光电气	新股发行	1,447	74,433.68
中信证券	688575	亚辉龙	新股发行	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	新股发行	3,170	50,181.10
中信证券	600955	维远股份	新股发行	1,694	50,074.64
中信证券	300993	玉马遮阳	新股发行	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	新股发行	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	新股发行	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	新股发行	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	新股发行	3,220	42,214.20
中信证券	301028	东亚机械	新股发行	7,329	38,916.99
中信证券	301049	超越科技	新股发行	1,954	37,790.36
中信证券	688509	正元地信	新股发行	15,433	30,403.01
中信证券	603529	爱玛科技	新股发行	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	新股发行	3,477	28,059.39
中信证券	603071	物产环能	新股发行	1,627	25,088.34
中信证券	301055	张小泉	新股发行	3,541	24,432.90
中信证券	300966	共同药业	新股发行	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	新股发行	2,464	23,136.96
中信证券	605555	德昌股份	新股发行	655	21,189.25
中信证券	301059	金三江	新股发行	2,581	20,880.29
中信证券	600935	华塑股份	新股发行	4,811	18,955.34
中信证券	301053	远信工业	新股发行	1,544	18,327.28
中信证券	301062	上海艾录	新股发行	5,225	17,294.75
中信证券	688226	威腾电气	新股发行	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	新股发行	3,371	16,821.29
中信证券	688305	科德数控	新股发行	1,496	16,500.88
中信证券	688071	华依科技	新股发行	1,101	15,116.73
中信证券	605566	福莱蒾特	新股发行	435	14,011.35
中信证券	605060	联德股份	新股发行	883	13,765.97
中信证券	605599	菜百股份	新股发行	980	9,800.00
中信证券	605488	福莱新材	新股发行	416	8,498.88
中信证券	605138	盛泰集团	新股发行	723	7,208.31

中信证券	001208	华菱线缆	新股发行	1,754	6,437.18
中信证券	605020	永和股份	新股发行	850	5,890.50
中信证券	003040	楚天龙	新股发行	1,101	5,086.62
中信证券	001219	青岛食品	新股发行	272	4,678.40
中信证券	601279	英利汽车	新股发行	2,004	4,148.28
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	600919	江苏银行	配股发行	4,481,076	20,568,138.84
中信证券	600999	招商证券	配股发行	1,414,756	10,554,079.76
中信证券	688057	金达莱	新股发行	21,850	564,604.00
中信证券	300896	爱美客	新股发行	4,730	559,417.10
中信证券	688289	圣湘生物	新股发行	6,806	343,566.88
中信证券	688221	前沿生物	新股发行	16,148	331,034.00
中信证券	688578	艾力斯	新股发行	10,734	243,983.82
中信证券	300900	广联航空	新股发行	8,782	156,934.34
中信证券	688617	惠泰医疗	新股发行	1,673	124,571.58
中信证券	688559	海目星	新股发行	5,924	86,253.44
中信证券	300898	熊猫乳品	新股发行	4,953	53,393.34
中信证券	605136	丽人丽妆	新股发行	867	10,603.41
中信证券	003013	地铁设计	新股发行	724	9,723.32
中信证券	605099	共创草坪	新股发行	624	9,634.56
中信证券	003018	金富科技	新股发行	1,027	9,171.11
中信证券	605179	一鸣食品	新股发行	939	8,648.19
中信证券	003015	日久光电	新股发行	1,128	7,410.96
中信证券	605299	舒华体育	新股发行	738	5,365.26
中信证券	003006	百亚股份	新股发行	804	5,314.44

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 2,618,556,300.00 元（上年度可比期间：4,159,502,100.00 元），支付给中信期货的佣金为 86,412.34 元（上年度可比期间为：137,263.83 元）。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 290,985,142.31 元，占基金资产净值的比例为 1.01%（2020 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 387,008,134.80 元，占基金资产净值的比例为 1.27%）。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括工商银行而被动）持有的工商银行股票估值总额为人民币 209,823,909.57 元，占基金资产净值的比例为 0.73%（2020 年 12 月 31 日，本基金（因

指数成份股包括工商银行而被动)持有的工商银行股票估值总额为人民币 270,129,353.61 元, 占基金资产净值的比例为 0.88%)。

7.4.11 利润分配情况

单位: 人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021-01-22	2021-01-25	-	0.960	533,975,983.52	-	533,975,983.52	-
合计				0.960	533,975,983.52	-	533,975,983.52	-

注: 根据本基金管理人于 2022 年 1 月 11 日发布的分红公告, 本基金向 2022 年 1 月 14 日在本基金登记结算机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.790 元。

7.4.12 期末 (2021 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
600745	闻泰科技	2021-08-19	2022-02-21	大宗转让流通受限	93.66	125.67	200,000	18,732,000.00	25,134,000.00	-
688012	中微公司	2021-07-23	2022-01-24	大宗转让流通受限	182.00	124.62	75,000	13,650,000.00	9,346,500.00	-
601360	三六零	2021-07-21	2022-01-21	大宗转让流通受限	11.59	12.60	700,000	8,113,000.00	8,820,000.00	-

603486	科沃斯	2021-12-08	2022-06-08	大宗转让 流通受限	152.99	137.79	60,000	9,179,400.00	8,267,400.00	-
300677	英科医疗	2021-07-30	2022-02-07	大宗转让 流通受限	102.89	56.49	60,000	4,115,600.00	3,389,400.00	-
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	新发 流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688176	亚虹医药	2021-12-29	2022-01-07	新发 流通受限	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688385	复旦微电	2021-07-27	2022-02-07	新发 流通受限	6.23	48.58	8,986	55,982.78	436,539.88	-
688789	宏华数科	2021-07-01	2022-01-10	新发 流通受限	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
688553	汇宇制药	2021-10-14	2022-04-26	新发 流通受限	38.87	32.11	8,928	347,031.36	286,678.08	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新发 流通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
688787	海天瑞声	2021-08-05	2022-02-14	新发 流通受限	36.94	87.35	817	30,179.98	71,364.95	-
688272	富吉瑞	2021-10-08	2022-04-18	新发 流通受限	22.56	39.09	1,263	28,493.28	49,370.67	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新发 流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新发 流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新发 流通受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新发 流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-

301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	新发流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新发流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新发流通受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新发流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新发流通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新发流通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新发流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021-11-02	2022-04-27	新发流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新发流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新发流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新发流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新发流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新发流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新发流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新发流通	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-

				受限						
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新发流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新发流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	新发流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新发流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新发流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新发流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新发流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新发流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新发流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新发流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新发流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新发流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新发流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新发流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
30103	迈普	2021-0	2022-0	新发	15.14	59.97	108	1,635.	6,476.	-

3	医学	7-15	1-26	流通受限				12	76	
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新发流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新发流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新发流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新发流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新发流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新发流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新发流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新发流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新发流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新发流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新发流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新发流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新发流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新发流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-

301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新发流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新发流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新发流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

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

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

⑥以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位： 股)	期末估值总 额
1	300059	东方财富	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	37.11	2,448,500.0 0	90,863,835. 00
2	000858	五粮液	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	222.6 6	258,800.00	57,624,408. 00
3	601012	隆基股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	86.20	652,800.00	56,271,360. 00
4	600036	招商银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	48.71	1,113,000.0 0	54,214,230. 00
5	000725	京东方 A	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	5.05	9,156,000.0 0	46,237,800. 00
6	000333	美的集团	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 26 日	73.81	603,400.00	44,536,954. 00
7	601318	中国平安	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	50.41	876,800.00	44,199,488. 00
8	000568	泸州老窖	2022 年 1 月 4 日	253.8	171,500.00	43,538,705.

			-2022 年 1 月 28 日	7		00
9	600519	贵州茅台	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 7 日	2,050. 00	20,000.00	41,000,000. 00
10	000001	平安银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	16.48	2,338,800.0 0	38,543,424. 00
11	000002	万科 A	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	19.76	1,858,800.0 0	36,729,888. 00
12	002352	顺丰控股	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	68.92	510,600.00	35,190,552. 00
13	601919	中远海控	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	18.69	1,737,200.0 0	32,468,268. 00
14	300015	爱尔眼科	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	42.28	703,200.00	29,731,296. 00
15	600111	北方稀土	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	45.80	628,900.00	28,803,620. 00
16	002142	宁波银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 26 日	38.28	685,200.00	26,229,456. 00
17	600406	国电南瑞	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	40.03	653,700.00	26,167,611. 00
18	000338	潍柴动力	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	17.89	1,456,800.0 0	26,062,152. 00
19	002594	比亚迪	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 26 日	268.1 2	93,100.00	24,961,972. 00
20	002230	科大讯飞	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	52.51	472,200.00	24,795,222. 00
21	002460	赣锋锂业	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	142.8 5	160,800.00	22,970,280. 00
22	002714	牧原股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	53.36	421,000.00	22,464,560. 00
23	000063	中兴通讯	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	33.50	622,500.00	20,853,750. 00
24	603986	兆易创新	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	175.8 5	116,700.00	20,521,695. 00
25	601166	兴业银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	19.04	1,055,000.0 0	20,087,200. 00
26	601669	中国电建	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	8.08	2,465,600.0 0	19,922,048. 00
27	002304	洋河股份	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 28 日	164.7 3	120,200.00	19,800,546. 00
28	600276	恒瑞医药	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	50.71	387,300.00	19,639,983. 00
29	601988	中国银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	3.05	6,218,200.0 0	18,965,510. 00
30	000651	格力电器	2022 年 1 月 4 日	37.03	510,900.00	18,918,627.

			-2022 年 1 月 28 日			00
31	601985	中国核电	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	8.30	2,265,600.0 0	18,804,480. 00
32	000776	广发证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	24.59	749,600.00	18,432,664. 00
33	600436	片仔癀	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	437.1 5	41,700.00	18,229,155. 00
34	603259	药明康德	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	118.5 8	150,300.00	17,822,574. 00
35	002475	立讯精密	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	49.20	359,500.00	17,687,400. 00
36	000538	云南白药	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	104.6 5	163,600.00	17,120,740. 00
37	000625	长安汽车	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	15.19	1,098,300.0 0	16,683,177. 00
38	300014	亿纬锂能	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	118.1 8	137,200.00	16,214,296. 00
39	600887	伊利股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	41.46	381,100.00	15,800,406. 00
40	600809	山西汾酒	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 26 日	315.7 8	50,000.00	15,789,000. 00
41	601600	中国铝业	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	6.09	2,591,900.0 0	15,784,671. 00
42	002271	东方雨虹	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	52.68	297,100.00	15,651,228. 00
43	603501	韦尔股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 26 日	310.7 7	50,000.00	15,538,500. 00
44	002415	海康威视	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	52.32	296,300.00	15,502,416. 00
45	600958	东方证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	14.74	1,045,600.0 0	15,412,144. 00
46	300142	沃森生物	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	56.20	273,000.00	15,342,600. 00
47	603806	福斯特	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	130.5 5	116,700.00	15,235,185. 00
48	600010	宝钢股份	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	2.79	5,445,100.0 0	15,191,829. 00
49	002812	恩捷股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 26 日	250.4 0	60,000.00	15,024,000. 00
50	002129	中环股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	41.75	354,100.00	14,783,675. 00
51	601888	中国中免	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	219.4 1	66,400.00	14,568,824. 00
52	603288	海天味业	2022 年 1 月 4 日	105.1	137,600.00	14,463,136.

			-2022 年 1 月 28 日	1		00
53	603659	璞泰来	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	160.6 1	90,000.00	14,454,900. 00
54	603799	华友钴业	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 28 日	110.3 1	129,900.00	14,329,269. 00
55	002241	歌尔股份	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 28 日	54.10	263,500.00	14,255,350. 00
56	600309	万华化学	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 28 日	101.0 0	140,700.00	14,210,700. 00
57	300274	阳光电源	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	145.8 0	96,900.00	14,128,020. 00
58	600011	华能国际	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	9.69	1,407,000.0 0	13,633,830. 00
59	600031	三一重工	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	22.80	597,700.00	13,627,560. 00
60	600900	长江电力	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 26 日	22.70	595,200.00	13,511,040. 00
61	600660	福耀玻璃	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	47.14	286,100.00	13,486,754. 00
62	600905	三峡能源	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 17 日	7.51	1,777,700.0 0	13,350,527. 00
63	601633	长城汽车	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	48.54	272,900.00	13,246,566. 00
64	601899	紫金矿业	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	9.70	1,345,900.0 0	13,055,230. 00
65	601328	交通银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	4.61	2,811,200.0 0	12,959,632. 00
66	002027	分众传媒	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	8.19	1,581,900.0 0	12,955,761. 00
67	000768	中航西飞	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	36.50	347,100.00	12,669,150. 00
68	600150	中国船舶	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	24.79	507,000.00	12,568,530. 00
69	002466	天齐锂业	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 13 日	107.0 0	114,800.00	12,283,600. 00
70	601989	中国重工	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	4.22	2,724,100.0 0	11,495,702. 00
71	601398	工商银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	4.63	2,459,700.0 0	11,388,411. 00
72	600760	中航沈飞	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	68.04	166,700.00	11,342,268. 00
73	600745	闻泰科技	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	129.3 0	87,200.00	11,274,960. 00
74	002008	大族激光	2022 年 1 月 4 日	54.00	207,900.00	11,226,600.

			-2022 年 1 月 28 日			00
75	002202	金风科技	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	16.47	660,200.00	10,873,494.00
76	600000	浦发银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	8.53	1,273,200.00	10,860,396.00
77	600588	用友网络	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	35.88	302,200.00	10,842,936.00
78	600196	复星医药	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	48.94	218,400.00	10,688,496.00
79	300498	温氏股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	19.26	550,100.00	10,594,926.00
80	002371	北方华创	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 10 日	347.02	30,000.00	10,410,600.00
81	600585	海螺水泥	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	40.30	253,300.00	10,207,990.00
82	601877	正泰电器	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	53.89	189,000.00	10,185,210.00
83	600352	浙江龙盛	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	12.63	789,100.00	9,966,333.00
84	002602	世纪华通	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	8.39	1,180,000.00	9,900,200.00
85	600547	山东黄金	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	18.82	525,200.00	9,884,264.00
86	600346	恒力石化	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	22.97	424,700.00	9,755,359.00
87	300124	汇川技术	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	68.60	142,100.00	9,748,060.00
88	601238	广汽集团	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	15.19	638,600.00	9,700,334.00
89	000895	双汇发展	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	31.55	306,300.00	9,663,765.00
90	600690	海尔智家	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	29.89	319,700.00	9,555,833.00
91	000425	徐工机械	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	5.99	1,585,200.00	9,495,348.00
92	600893	航发动力	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	63.46	147,700.00	9,373,042.00
93	600438	通威股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	44.96	204,200.00	9,180,832.00
94	300750	宁德时代	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 13 日	588.00	15,600.00	9,172,800.00
95	601100	恒立液压	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	81.80	111,700.00	9,137,060.00
96	600795	国电电力	2022 年 1 月 3 日	3.17	2,868,800.00	9,094,096.00

			-2022 年 1 月 28 日		0	0
97	002049	紫光国微	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 26 日	225.0 0	40,000.00	9,000,000.0 0
98	600115	中国东航	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	5.16	1,736,600.0 0	8,960,856.0 0
99	002601	龙佰集团	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	28.59	312,800.00	8,942,952.0 0
100	600016	民生银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	3.90	2,283,800.0 0	8,906,820.0 0
101	002841	视源股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	81.40	106,700.00	8,685,380.0 0
102	601816	京沪高铁	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	4.83	1,783,200.0 0	8,612,856.0 0
103	000157	中联重科	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	7.17	1,200,800.0 0	8,609,736.0 0
104	600570	恒生电子	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	62.15	136,400.00	8,477,260.0 0
105	600837	海通证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	12.26	691,000.00	8,471,660.0 0
106	000166	申万宏源	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 28 日	5.12	1,647,900.0 0	8,437,248.0 0
107	000876	新希望	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	15.21	554,500.00	8,433,945.0 0
108	600989	宝丰能源	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	17.36	483,900.00	8,400,504.0 0
109	600383	金地集团	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	12.97	645,600.00	8,373,432.0 0
110	688012	中微公司	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 26 日	126.6 0	66,000.00	8,355,600.0 0
111	601288	农业银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	2.94	2,816,800.0 0	8,281,392.0 0
112	601229	上海银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	7.13	1,160,900.0 0	8,277,217.0 0
113	000661	长春高新	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 10 日	271.4 0	30,000.00	8,142,000.0 0
114	600085	同仁堂	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	44.98	178,200.00	8,015,436.0 0
115	000963	华东医药	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	40.20	195,300.00	7,851,060.0 0
116	603882	金域医学	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	111.3 7	70,000.00	7,795,900.0 0
117	000301	东方盛虹	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 17 日	19.34	401,200.00	7,759,208.0 0
118	601788	光大证券	2022 年 1 月 4 日	14.93	518,200.00	7,736,726.0

			-2022 年 1 月 28 日			0
119	601377	兴业证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	9.88	778,100.00	7,687,628.0 0
120	600015	华夏银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	5.60	1,346,700.0 0	7,541,520.0 0
121	000100	TCL 科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	6.17	1,216,400.0 0	7,505,188.0 0
122	000066	中国长城	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	14.16	527,300.00	7,466,568.0 0
123	601799	星宇股份	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 17 日	204.2 5	36,400.00	7,434,700.0 0
124	601111	中国国航	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	9.13	812,700.00	7,419,951.0 0
125	000703	恒逸石化	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	10.62	698,100.00	7,413,822.0 0
126	603993	洛阳钼业	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	5.58	1,325,200.0 0	7,394,616.0 0
127	603160	汇顶科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	107.7 7	68,600.00	7,393,022.0 0
128	601939	建设银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	5.86	1,259,400.0 0	7,380,084.0 0
129	002311	海大集团	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	73.30	99,400.00	7,286,020.0 0
130	601088	中国神华	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	22.52	320,400.00	7,215,408.0 0
131	600332	白云山	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	34.20	210,800.00	7,209,360.0 0
132	600104	上汽集团	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	20.63	348,200.00	7,183,366.0 0
133	300760	迈瑞医疗	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 13 日	380.8 0	18,400.00	7,006,720.0 0
134	600426	华鲁恒升	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	31.30	222,800.00	6,973,640.0 0
135	300122	智飞生物	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	124.6 0	55,300.00	6,890,380.0 0
136	601601	中国太保	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	27.12	251,500.00	6,820,680.0 0
137	603019	中科曙光	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	27.57	246,600.00	6,798,762.0 0
138	001979	招商蛇口	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	13.34	504,300.00	6,727,362.0 0
139	601688	华泰证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	17.76	378,600.00	6,723,936.0 0
140	002179	中航光电	2022 年 1 月 7 日	100.5	66,700.00	6,707,352.0

			-2022 年 1 月 28 日	6		0
141	600161	天坛生物	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	28.96	231,000.00	6,689,760.0 0
142	002050	三花智控	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	25.30	263,500.00	6,666,550.0 0
143	601766	中国中车	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	6.09	1,093,200.0 0	6,657,588.0 0
144	601021	春秋航空	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	56.80	116,800.00	6,634,240.0 0
145	002410	广联达	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	63.98	103,100.00	6,596,338.0 0
146	601668	中国建筑	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	5.00	1,307,500.0 0	6,537,500.0 0
147	600143	金发科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	12.58	519,500.00	6,535,310.0 0
148	002252	上海莱士	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	6.82	957,900.00	6,532,878.0 0
149	002493	荣盛石化	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	18.16	354,500.00	6,437,720.0 0
150	300347	泰格医药	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	127.8 0	50,000.00	6,390,000.0 0
151	600919	江苏银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	5.83	1,095,700.0 0	6,387,931.0 0
152	601878	浙商证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	13.18	481,100.00	6,340,898.0 0
153	688008	澜起科技	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	83.87	73,900.00	6,197,993.0 0
154	600050	中国联通	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	3.93	1,567,800.0 0	6,161,454.0 0
155	600999	招商证券	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	17.65	347,500.00	6,133,375.0 0
156	600048	保利发展	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	15.63	392,100.00	6,128,523.0 0
157	601865	福莱特	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 13 日	57.94	105,100.00	6,089,494.0 0
158	600132	重庆啤酒	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	151.3 2	40,000.00	6,052,800.0 0
159	002624	完美世界	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	20.31	296,800.00	6,028,008.0 0
160	601211	国泰君安	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	17.89	336,900.00	6,027,141.0 0
161	300450	先导智能	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	74.37	80,900.00	6,016,533.0 0
162	603939	益丰药房	2022 年 1 月 4 日	55.11	108,800.00	5,995,968.0

			-2022 年 1 月 28 日			0
163	600763	通策医疗	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 10 日	199.0 0	30,000.00	5,970,000.0 0
164	600600	青岛啤酒	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 28 日	99.00	60,000.00	5,940,000.0 0
165	600061	国投资本	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	8.22	721,800.00	5,933,196.0 0
166	601155	新城控股	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	29.13	202,400.00	5,895,912.0 0
167	601225	陕西煤业	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	12.20	480,300.00	5,859,660.0 0
168	002001	新和成	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	31.12	188,000.00	5,850,560.0 0
169	601390	中国中铁	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	5.79	1,009,000.0 0	5,842,110.0 0
170	603899	晨光文具	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	64.51	90,000.00	5,805,900.0 0
171	600019	宝钢股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	7.16	809,500.00	5,796,020.0 0
172	300999	金龙鱼	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 17 日	62.93	91,800.00	5,776,974.0 0
173	300003	乐普医疗	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	22.63	251,200.00	5,684,656.0 0
174	300676	华大基因	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	87.80	64,600.00	5,671,880.0 0
175	601006	大秦铁路	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	6.40	879,900.00	5,631,360.0 0
176	002600	领益智造	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	7.36	764,300.00	5,625,248.0 0
177	300413	芒果超媒	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	57.22	96,000.00	5,493,120.0 0
178	002007	华兰生物	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	29.14	188,200.00	5,484,148.0 0
179	601360	三六零	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	12.72	430,500.00	5,475,960.0 0
180	603517	绝味食品	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	68.33	80,000.00	5,466,400.0 0
181	000596	古井贡酒	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 17 日	244.0 0	22,300.00	5,441,200.0 0
182	601838	成都银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	12.00	452,000.00	5,424,000.0 0
183	601216	君正集团	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	5.23	1,036,600.0 0	5,421,418.0 0
184	600109	国金证券	2022 年 1 月 4 日	11.33	477,400.00	5,408,942.0

			-2022 年 1 月 28 日			0
185	603338	浙江鼎力	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	80.26	66,700.00	5,353,342.0 0
186	601108	财通证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	11.12	476,200.00	5,295,344.0 0
187	300033	同花顺	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	144.5 8	36,600.00	5,291,628.0 0
188	601169	北京银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	4.44	1,181,000.0 0	5,243,640.0 0
189	600362	江西铜业	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	22.33	234,700.00	5,240,851.0 0
190	002555	三七互娱	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	27.02	192,500.00	5,201,350.0 0
191	600028	中国石化	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	4.23	1,223,400.0 0	5,174,982.0 0
192	002236	大华股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	23.48	217,200.00	5,099,856.0 0
193	300408	三环集团	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 28 日	44.60	113,400.00	5,057,640.0 0
194	603369	今世缘	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	54.40	91,900.00	4,999,360.0 0
195	600489	中金黄金	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	8.23	607,100.00	4,996,433.0 0
196	002120	韵达股份	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	20.46	244,100.00	4,994,286.0 0
197	002024	苏宁易购	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	4.12	1,208,200.0 0	4,977,784.0 0
198	002157	正邦科技	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	9.66	510,800.00	4,934,328.0 0
199	600009	上海机场	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	46.69	105,000.00	4,902,450.0 0
200	600029	南方航空	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	6.81	712,800.00	4,854,168.0 0
201	601336	新华保险	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	38.88	124,500.00	4,840,560.0 0
202	000783	长江证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	7.54	639,200.00	4,819,568.0 0
203	601901	方正证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	7.84	613,100.00	4,806,704.0 0
204	601916	浙商银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	3.50	1,371,900.0 0	4,801,650.0 0
205	601009	南京银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	8.96	535,100.00	4,794,496.0 0
206	002414	高德红外	2022 年 1 月 3 日	24.21	195,300.00	4,728,213.0

			-2022 年 1 月 28 日			0
207	600741	华域汽车	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	28.30	164,200.00	4,646,860.0 0
208	601933	永辉超市	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	4.05	1,144,100.0 0	4,633,605.0 0
209	601818	光大银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	3.32	1,393,800.0 0	4,627,416.0 0
210	000977	浪潮信息	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	35.83	125,300.00	4,489,499.0 0
211	601628	中国人寿	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	30.09	148,700.00	4,474,383.0 0
212	600872	中炬高新	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	37.97	116,300.00	4,415,911.0 0
213	601658	邮储银行	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	5.10	865,200.00	4,412,520.0 0
214	000069	华侨城 A	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	7.04	626,500.00	4,410,560.0 0
215	600655	豫园股份	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	10.30	427,800.00	4,406,340.0 0
216	002821	凯莱英	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 10 日	435.0 0	10,000.00	4,350,000.0 0
217	600079	人福医药	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	22.52	191,100.00	4,303,572.0 0
218	600848	上海临港	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	14.87	289,000.00	4,297,430.0 0
219	000786	北新建材	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	35.83	119,900.00	4,296,017.0 0
220	002044	美年健康	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	7.85	543,200.00	4,264,120.0 0
221	600606	绿地控股	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	4.34	980,500.00	4,255,370.0 0
222	601607	上海医药	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	19.87	214,100.00	4,254,167.0 0
223	600176	中国巨石	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	18.20	232,100.00	4,224,220.0 0
224	300628	亿联网络	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	81.45	51,700.00	4,210,965.0 0
225	601186	中国铁建	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	7.80	530,000.00	4,134,000.0 0
226	300601	康泰生物	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	98.54	41,900.00	4,128,826.0 0
227	601618	中国中冶	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	3.83	1,068,300.0 0	4,091,589.0 0
228	002607	中公教育	2022 年 1 月 4 日	7.86	515,800.00	4,054,188.0

			-2022 年 1 月 28 日			0
229	002064	华峰化学	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 13 日	10.44	359,400.00	3,752,136.0 0
230	300558	贝达药业	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	79.83	46,900.00	3,744,027.0 0
231	600845	宝信软件	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	60.83	60,000.00	3,649,800.0 0
232	002791	坚朗五金	2022 年 1 月 17 日 -2022 年 1 月 25 日	181.5 9	20,000.00	3,631,800.0 0
233	603658	安图生物	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 17 日	55.06	65,400.00	3,600,924.0 0
234	600018	上港集团	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	5.48	646,800.00	3,544,464.0 0
235	300529	健帆生物	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 28 日	53.30	64,300.00	3,427,190.0 0
236	600025	华能水电	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	6.59	518,900.00	3,419,551.0 0
237	603195	公牛集团	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 17 日	167.3 0	20,000.00	3,346,000.0 0
238	000938	紫光股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	22.85	144,600.00	3,304,110.0 0
239	600183	生益科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	23.55	140,100.00	3,299,355.0 0
240	601857	中国石油	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	4.91	671,300.00	3,296,083.0 0
241	300595	欧普康视	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	57.37	56,500.00	3,241,405.0 0
242	601138	工业富联	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	11.92	267,800.00	3,192,176.0 0
243	300677	英科医疗	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	57.84	55,100.00	3,186,984.0 0
244	600886	国投电力	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	11.47	272,700.00	3,127,869.0 0
245	688126	沪硅产业	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	25.82	119,300.00	3,080,326.0 0
246	601236	红塔证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	11.92	256,800.00	3,061,056.0 0
247	002916	深南电路	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 14 日	121.8 2	24,600.00	2,996,772.0 0
248	600926	杭州银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	12.82	233,400.00	2,992,188.0 0
249	603833	欧派家居	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 28 日	147.5 0	20,000.00	2,950,000.0 0
250	601696	中银证券	2022 年 1 月 4 日	13.45	218,300.00	2,936,135.0

			-2022 年 1 月 28 日			0
251	300433	蓝思科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	22.98	124,700.00	2,865,606.0 0
252	603233	大参林	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	42.11	66,200.00	2,787,682.0 0
253	601162	天风证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	4.05	686,600.00	2,780,730.0 0
254	002568	百润股份	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 13 日	59.83	45,600.00	2,728,248.0 0
255	000708	中信特钢	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	20.48	131,300.00	2,689,024.0 0
256	601319	中国人保	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	4.70	566,200.00	2,661,140.0 0
257	300144	宋城演艺	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	14.32	185,300.00	2,653,496.0 0
258	002736	国信证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	11.48	230,800.00	2,649,584.0 0
259	601990	南京证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	9.91	264,800.00	2,624,168.0 0
260	601800	中国交建	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	8.58	298,000.00	2,556,840.0 0
261	600918	中泰证券	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	9.97	254,300.00	2,535,371.0 0
262	688009	中国通号	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	4.98	505,600.00	2,517,888.0 0
263	601995	中金公司	2022 年 1 月 7 日 -2022 年 1 月 28 日	49.03	50,000.00	2,451,500.0 0
264	601881	中国银河	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	11.19	212,200.00	2,374,518.0 0
265	300866	安克创新	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 17 日	102.5 0	23,000.00	2,357,500.0 0
266	601808	中海油服	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	15.00	156,000.00	2,340,000.0 0
267	600584	长电科技	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 26 日	31.02	70,700.00	2,193,114.0 0
268	300896	爱美客	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 17 日	536.1 1	3,900.00	2,090,829.0 0
269	601231	环旭电子	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	16.06	123,700.00	1,986,622.0 0
270	601698	中国卫通	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 28 日	14.39	136,900.00	1,969,991.0 0
271	000800	一汽解放	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	10.29	187,400.00	1,928,346.0 0
272	002032	苏泊尔	2022 年 1 月 10 日	62.24	30,800.00	1,916,992.0

			-2022 年 1 月 13 日			0
273	601898	中煤能源	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 13 日	6.29	301,500.00	1,896,435.0 0
274	601066	中信建投	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 10 日	29.25	62,500.00	1,828,125.0 0
275	688981	中芯国际	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 17 日	52.99	32,900.00	1,743,371.0 0
276	002709	天赐材料	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 13 日	114.6 5	14,600.00	1,673,890.0 0
277	688169	石头科技	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 12 日	813.0 0	2,000.00	1,626,000.0 0
278	300782	卓胜微	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 17 日	326.8 0	4,700.00	1,535,960.0 0
279	601998	中信银行	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 28 日	4.62	329,800.00	1,523,676.0 0
280	300888	稳健医疗	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 17 日	82.45	18,000.00	1,484,100.0 0
281	601727	上海电气	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 4 日	4.86	291,400.00	1,416,204.0 0
282	688363	华熙生物	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 26 日	155.3 0	8,700.00	1,351,110.0 0
283	688111	金山办公	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 26 日	265.0 0	5,000.00	1,325,000.0 0
284	688036	传音控股	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 26 日	156.9 0	7,700.00	1,208,130.0 0
285	688396	华润微	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 26 日	64.60	17,800.00	1,149,880.0 0
286	300316	晶盛机电	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 17 日	69.50	16,200.00	1,125,900.0 0
287	601966	玲珑轮胎	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 13 日	36.55	30,100.00	1,100,155.0 0
288	688599	天合光能	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 13 日	78.90	13,800.00	1,088,820.0 0
289	300759	康龙化成	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 13 日	141.2 7	5,700.00	805,239.00
290	688561	奇安信	2022 年 1 月 13 日 -2022 年 1 月 13 日	87.92	8,000.00	703,360.00
291	600030	中信证券	2022 年 1 月 10 日 -2022 年 1 月 10 日	26.41	23,400.00	617,994.00
合计					161,925,900 .00	2,835,419,2 93.00

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.3 流动性风险

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

除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	28,697,060,869.42	99.27	30,302,438,423.12	99.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	1,829,000.00	0.01
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	28,697,060,869.42	99.27	30,304,267,423.12	99.07

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	-5%	-1,421,312,479.96	-1,316,317,893.44
	+5%	1,421,312,479.96	1,316,317,893.44

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

（2）各层次金融工具公允价值

截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 28,638,531,609.39 元，第二层次的余额为 58,529,260.03 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2020 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 30,243,172,462.49 元，第二层次的余额为 61,094,960.63 元，第三

层次的余额为 0 元。)

(3) 公允价值所属层次间的重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票,本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次,于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票,本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次,于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

(4) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

(5) 新金融工具准则

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	28,697,060,869.42	98.77
	其中:股票	28,697,060,869.42	98.77
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	215,997,304.64	0.74

	计		
8	其他各项资产	139,966,719.62	0.48
9	合计	29,053,024,893.68	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 2,835,419,293.00 元, 占本基金期末资产净值的 9.81%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	312,294,564.76	1.08
B	采矿业	625,057,176.47	2.16
C	制造业	16,935,350,132.11	58.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	691,265,115.51	2.39
E	建筑业	480,009,540.88	1.66
F	批发和零售业	177,351,251.47	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	756,708,191.98	2.62
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	940,243,672.88	3.25
J	金融业	6,040,246,145.62	20.89
K	房地产业	501,429,459.47	1.73
L	租赁和商务服务业	384,009,055.69	1.33
M	科学研究和技术服务业	477,196,212.34	1.65
N	水利、环境和公共设施管理业	40,839.39	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	18,791,688.00	0.07
Q	卫生和社会工作	272,724,996.19	0.94
R	文化、体育和娱乐业	84,338,218.66	0.29
S	综合	-	-
	合计	28,697,060,869.42	99.27

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	814,215	1,669,140,750.00	5.77
2	300750	宁德时代	1,808,146	1,063,189,848.00	3.68
3	600036	招商银行	16,006,447	779,674,033.37	2.70
4	601318	中国平安	14,007,916	706,139,045.56	2.44
5	000858	五粮液	2,512,015	559,325,259.90	1.93
6	601012	隆基股份	5,598,180	482,563,116.00	1.67

7	000333	美的集团	6,327,803	467,055,139.43	1.62
8	300059	东方财富	10,690,771	396,734,511.81	1.37
9	601166	兴业银行	18,801,070	357,972,372.80	1.24
10	600900	长江电力	14,704,663	333,795,850.10	1.15
11	002415	海康威视	6,039,500	315,986,640.00	1.09
12	603259	药明康德	2,653,145	314,609,934.10	1.09
13	002594	比亚迪	1,171,792	314,180,871.04	1.09
14	002475	立讯精密	6,385,216	314,152,627.20	1.09
15	600276	恒瑞医药	5,790,267	293,624,439.57	1.02
16	600030	中信证券	11,017,991	290,985,142.31	1.01
17	601888	中国中免	1,262,300	276,961,243.00	0.96
18	600887	伊利股份	6,623,796	274,622,582.16	0.95
19	000568	泸州老窖	951,329	241,513,893.23	0.84
20	300760	迈瑞医疗	628,845	239,464,176.00	0.83
21	000651	格力电器	6,115,680	226,463,630.40	0.78
22	601398	工商银行	45,318,339	209,823,909.57	0.73
23	603501	韦尔股份	674,731	209,686,152.87	0.73
24	000001	平安银行	12,544,877	206,739,572.96	0.72
25	600309	万华化学	2,031,446	205,176,046.00	0.71
26	600809	山西汾酒	630,993	199,254,969.54	0.69
27	002142	宁波银行	5,131,215	196,422,910.20	0.68
28	300274	阳光电源	1,345,831	196,222,159.80	0.68
29	000725	京东方 A	38,845,800	196,171,290.00	0.68
30	002714	牧原股份	3,408,437	181,874,198.32	0.63
31	601899	紫金矿业	18,642,642	180,833,627.40	0.63
32	600031	三一重工	7,687,568	175,276,550.40	0.61
33	002352	顺丰控股	2,537,632	174,893,597.44	0.60
34	000002	万科 A	8,810,690	174,099,234.40	0.60
35	002812	恩捷股份	693,576	173,671,430.40	0.60
36	300014	亿纬锂能	1,468,589	173,557,848.02	0.60
37	603288	海天味业	1,631,056	171,440,296.16	0.59
38	600436	片仔癀	387,216	169,271,474.40	0.59
39	002241	歌尔股份	3,094,387	167,406,336.70	0.58
40	601328	交通银行	35,528,867	163,788,076.87	0.57
41	300124	汇川技术	2,377,665	163,107,819.00	0.56
42	600438	通威股份	3,495,017	157,135,964.32	0.54
43	600837	海通证券	12,482,769	153,038,747.94	0.53
44	601919	中远海控	8,183,712	152,953,577.28	0.53
45	002460	赣锋锂业	1,039,012	148,422,864.20	0.51
46	300015	爱尔眼科	3,500,829	148,015,050.12	0.51
47	600690	海尔智家	4,892,331	146,231,773.59	0.51
48	600048	保利发展	9,284,193	145,111,936.59	0.50
49	600406	国电南瑞	3,582,764	143,418,042.92	0.50
50	002466	天齐锂业	1,337,752	143,139,464.00	0.50

51	603799	华友钴业	1,263,275	139,351,865.25	0.48
52	000063	中兴通讯	4,113,582	137,804,997.00	0.48
53	601668	中国建筑	27,120,122	135,600,610.00	0.47
54	601288	农业银行	45,406,425	133,494,889.50	0.46
55	688981	中芯国际	2,506,201	132,803,590.99	0.46
56	600000	浦发银行	15,181,201	129,495,644.53	0.45
57	600111	北方稀土	2,821,951	129,245,355.80	0.45
58	300122	智飞生物	1,032,924	128,702,330.40	0.45
59	002304	洋河股份	781,099	128,670,438.27	0.45
60	600016	民生银行	32,096,553	125,176,556.70	0.43
61	600585	海螺水泥	3,102,333	125,024,019.90	0.43
62	002230	科大讯飞	2,377,941	124,865,681.91	0.43
63	600104	上汽集团	6,045,736	124,723,533.68	0.43
64	600745	闻泰科技	962,480	123,722,664.00	0.43
65	002049	紫光国微	548,740	123,466,500.00	0.43
66	601816	京沪高铁	25,399,429	122,679,242.07	0.42
67	002129	中环股份	2,922,313	122,006,567.75	0.42
68	603986	兆易创新	690,802	121,477,531.70	0.42
69	002271	东方雨虹	2,284,120	120,327,441.60	0.42
70	601601	中国太保	4,425,324	120,014,786.88	0.42
71	601688	华泰证券	6,663,366	118,341,380.16	0.41
72	002371	北方华创	337,094	116,978,359.88	0.40
73	300142	沃森生物	2,026,860	113,909,532.00	0.39
74	000661	长春高新	416,563	113,055,198.20	0.39
75	000100	TCL 科技	18,166,466	112,087,095.22	0.39
76	300498	温氏股份	5,749,772	110,740,608.72	0.38
77	000338	潍柴动力	6,144,733	109,929,273.37	0.38
78	600893	航发动力	1,721,282	109,232,555.72	0.38
79	002027	分众传媒	13,070,551	107,047,812.69	0.37
80	300450	先导智能	1,419,732	105,585,468.84	0.37
81	601211	国泰君安	5,833,062	104,353,479.18	0.36
82	300782	卓胜微	298,598	97,581,826.40	0.34
83	601088	中国神华	4,262,768	95,997,535.36	0.33
84	601766	中国中车	15,727,193	95,778,605.37	0.33
85	600050	中国联通	24,043,600	94,491,348.00	0.33
86	000776	广发证券	3,831,414	94,214,470.26	0.33
87	600570	恒生电子	1,514,748	94,141,588.20	0.33
88	601229	上海银行	12,861,000	91,698,930.00	0.32
89	600919	江苏银行	15,279,045	89,076,832.35	0.31
90	300347	泰格医药	679,477	86,837,160.60	0.30
91	600660	福耀玻璃	1,811,916	85,413,720.24	0.30
92	002709	天赐材料	742,600	85,139,090.00	0.29
93	601169	北京银行	19,138,719	84,975,912.36	0.29
94	600999	招商证券	4,801,628	84,748,734.20	0.29

95	688599	天合光能	1,067,345	84,213,520.50	0.29
96	002821	凯莱英	191,972	83,507,820.00	0.29
97	600905	三峡能源	11,086,663	83,260,839.13	0.29
98	601988	中国银行	27,254,152	83,125,163.60	0.29
99	600019	宝钢股份	11,518,897	82,475,302.52	0.29
100	600010	包钢股份	29,468,225	82,216,347.75	0.28
101	601669	中国电建	9,889,480	79,906,998.40	0.28
102	600958	东方证券	5,398,137	79,568,539.38	0.28
103	002410	广联达	1,228,911	78,625,725.78	0.27
104	002311	海大集团	1,072,373	78,604,940.90	0.27
105	601633	长城汽车	1,584,251	76,899,543.54	0.27
106	002459	晶澳科技	829,200	76,866,840.00	0.27
107	600196	复星医药	1,563,577	76,521,458.38	0.26
108	601390	中国中铁	13,170,109	76,254,931.11	0.26
109	600588	用友网络	2,116,907	75,954,623.16	0.26
110	601985	中国核电	9,062,207	75,216,318.10	0.26
111	601877	正泰电器	1,391,470	74,986,318.30	0.26
112	000625	长安汽车	4,926,909	74,839,747.71	0.26
113	000166	申万宏源	14,570,012	74,598,461.44	0.26
114	600028	中国石化	17,294,437	73,155,468.51	0.25
115	603659	璞泰来	446,855	71,769,381.55	0.25
116	601658	邮储银行	14,068,779	71,750,772.90	0.25
117	002179	中航光电	712,049	71,603,647.44	0.25
118	002493	荣盛石化	3,929,256	71,355,288.96	0.25
119	601818	光大银行	21,386,882	71,004,448.24	0.25
120	000895	双汇发展	2,239,440	70,654,332.00	0.24
121	000538	云南白药	661,624	69,238,951.60	0.24
122	601377	兴业证券	6,926,795	68,436,734.60	0.24
123	300408	三环集团	1,490,194	66,462,652.40	0.23
124	000768	中航西飞	1,789,908	65,331,642.00	0.23
125	601628	中国人寿	2,156,965	64,903,076.85	0.22
126	603806	福斯特	490,252	64,002,398.60	0.22
127	688111	金山办公	241,086	63,887,790.00	0.22
128	600346	恒力石化	2,732,826	62,773,013.22	0.22
129	002001	新和成	2,001,514	62,287,115.68	0.22
130	601989	中国重工	14,743,964	62,219,528.08	0.22
131	601600	中国铝业	10,146,946	61,794,901.14	0.21
132	601857	中国石油	12,561,102	61,675,010.82	0.21
133	601138	工业富联	5,138,664	61,252,874.88	0.21
134	601225	陕西煤业	5,013,829	61,168,713.80	0.21
135	300896	爱美客	113,181	60,677,465.91	0.21
136	600426	华鲁恒升	1,911,678	59,835,521.40	0.21
137	002008	大族激光	1,101,948	59,505,192.00	0.21
138	300433	蓝思科技	2,575,615	59,187,632.70	0.20

139	002202	金风科技	3,568,739	58,777,131.33	0.20
140	002050	三花智控	2,319,407	58,680,997.10	0.20
141	600009	上海机场	1,245,626	58,158,277.94	0.20
142	601009	南京银行	6,471,308	57,982,919.68	0.20
143	300316	晶盛机电	833,400	57,921,300.00	0.20
144	600741	华域汽车	2,039,917	57,729,651.10	0.20
145	600150	中国船舶	2,310,691	57,282,029.89	0.20
146	600763	通策医疗	286,232	56,960,168.00	0.20
147	600176	中国巨石	3,105,061	56,512,110.20	0.20
148	601100	恒立液压	675,655	55,268,579.00	0.19
149	300413	芒果超媒	965,217	55,229,716.74	0.19
150	600011	华能国际	5,688,069	55,117,388.61	0.19
151	001979	招商蛇口	4,094,159	54,616,081.06	0.19
152	002236	大华股份	2,322,858	54,540,705.84	0.19
153	300601	康泰生物	532,609	52,483,290.86	0.18
154	600760	中航沈飞	762,001	51,846,548.04	0.18
155	603993	洛阳钼业	9,132,880	50,961,470.40	0.18
156	601939	建设银行	8,681,385	50,872,916.10	0.18
157	600584	长电科技	1,614,695	50,087,838.90	0.17
158	600989	宝丰能源	2,847,152	49,426,558.72	0.17
159	688036	传音控股	314,570	49,356,033.00	0.17
160	601006	大秦铁路	7,690,400	49,218,560.00	0.17
161	600926	杭州银行	3,834,341	49,156,251.62	0.17
162	601066	中信建投	1,677,266	49,060,030.50	0.17
163	002602	世纪华通	5,784,663	48,533,322.57	0.17
164	688008	澜起科技	577,130	48,403,893.10	0.17
165	300759	康龙化成	338,584	47,831,761.68	0.17
166	003816	中国广核	15,267,700	47,787,901.00	0.17
167	000977	浪潮信息	1,317,745	47,214,803.35	0.16
168	000786	北新建材	1,312,660	47,032,607.80	0.16
169	601360	三六零	3,694,474	46,909,709.28	0.16
170	600132	重庆啤酒	309,200	46,788,144.00	0.16
171	002555	三七互娱	1,718,932	46,445,542.64	0.16
172	601186	中国铁建	5,952,524	46,429,687.20	0.16
173	000157	中联重科	6,427,308	46,083,798.36	0.16
174	601868	中国能建	16,770,000	45,782,100.00	0.16
175	000963	华东医药	1,129,758	45,416,271.60	0.16
176	600600	青岛啤酒	456,636	45,206,964.00	0.16
177	600029	南方航空	6,551,144	44,613,290.64	0.15
178	600015	华夏银行	7,955,362	44,550,027.20	0.15
179	000876	新希望	2,912,311	44,296,250.31	0.15
180	603369	今世缘	813,068	44,230,899.20	0.15
181	600886	国投电力	3,856,100	44,229,467.00	0.15
182	002601	龙佰集团	1,543,799	44,137,213.41	0.15

183	600547	山东黄金	2,334,581	43,936,814.42	0.15
184	603486	科沃斯	292,000	43,287,800.00	0.15
185	601238	广汽集团	2,819,360	42,826,078.40	0.15
186	002736	国信证券	3,727,948	42,796,843.04	0.15
187	600352	浙江龙盛	3,367,613	42,532,952.19	0.15
188	000425	徐工机械	7,091,912	42,480,552.88	0.15
189	000938	紫光股份	1,850,054	42,273,733.90	0.15
190	601336	新华保险	1,076,407	41,850,704.16	0.14
191	603019	中科曙光	1,516,394	41,806,982.58	0.14
192	601901	方正证券	5,317,900	41,692,336.00	0.14
193	002007	华兰生物	1,418,540	41,336,255.60	0.14
194	688012	中微公司	322,405	40,667,973.00	0.14
195	600085	同仁堂	889,476	40,008,630.48	0.14
196	603882	金域医学	358,056	39,876,696.72	0.14
197	300033	同花顺	274,644	39,708,029.52	0.14
198	000596	古井贡酒	160,309	39,115,396.00	0.14
199	601800	中国交建	4,558,364	39,110,763.12	0.14
200	002938	鹏鼎控股	903,600	38,339,748.00	0.13
201	601799	星宇股份	186,874	38,169,014.50	0.13
202	601865	福莱特	658,406	38,148,043.64	0.13
203	300595	欧普康视	660,818	37,911,128.66	0.13
204	300628	亿联网络	465,306	37,899,173.70	0.13
205	601916	浙商银行	10,806,800	37,823,800.00	0.13
206	600383	金地集团	2,915,954	37,819,923.38	0.13
207	000783	长江证券	5,006,161	37,746,453.94	0.13
208	601788	光大证券	2,525,664	37,708,163.52	0.13
209	000069	华侨城 A	5,305,327	37,349,502.08	0.13
210	300003	乐普医疗	1,631,193	36,913,897.59	0.13
211	600115	中国东航	7,086,028	36,563,904.48	0.13
212	600795	国电电力	11,525,285	36,535,153.45	0.13
213	000301	东方盛虹	1,876,086	36,283,503.24	0.13
214	601108	财通证券	3,249,432	36,133,683.84	0.12
215	600918	中泰证券	3,603,130	35,923,206.10	0.12
216	002252	上海莱士	5,231,502	35,678,843.64	0.12
217	600109	国金证券	3,128,036	35,440,647.88	0.12
218	601618	中国中冶	9,236,800	35,376,944.00	0.12
219	601111	中国国航	3,865,171	35,289,011.23	0.12
220	300999	金龙鱼	560,700	35,284,851.00	0.12
221	603833	欧派家居	239,013	35,254,417.50	0.12
222	600183	生益科技	1,495,994	35,230,658.70	0.12
223	603392	万泰生物	158,767	35,166,890.50	0.12
224	002841	视源股份	429,344	34,948,601.60	0.12
225	601155	新城控股	1,168,096	34,026,636.48	0.12
226	601838	成都银行	2,798,259	33,579,108.00	0.12

227	300529	健帆生物	625,042	33,314,738.60	0.12
228	601966	玲珑轮胎	890,010	32,529,865.50	0.11
229	603517	绝味食品	474,678	32,434,747.74	0.11
230	000066	中国长城	2,284,200	32,344,272.00	0.11
231	603160	汇顶科技	292,460	31,518,414.20	0.11
232	688561	奇安信	356,850	31,374,252.00	0.11
233	600332	白云山	912,120	31,194,504.00	0.11
234	600489	中金黄金	3,760,212	30,946,544.76	0.11
235	603899	晨光文具	478,121	30,843,585.71	0.11
236	002120	韵达股份	1,504,053	30,772,924.38	0.11
237	002624	完美世界	1,509,227	30,652,400.37	0.11
238	002791	坚朗五金	168,200	30,543,438.00	0.11
239	002916	深南电路	249,371	30,378,375.22	0.11
240	000703	恒逸石化	2,848,916	30,255,487.92	0.10
241	600362	江西铜业	1,342,569	29,979,565.77	0.10
242	601607	上海医药	1,494,549	29,696,688.63	0.10
243	002414	高德红外	1,214,447	29,401,761.87	0.10
244	600143	金发科技	2,327,100	29,274,918.00	0.10
245	300144	宋城演艺	2,032,129	29,100,087.28	0.10
246	002568	百润股份	483,000	28,897,890.00	0.10
247	300677	英科医疗	496,159	28,616,836.56	0.10
248	600079	人福医药	1,267,021	28,533,312.92	0.10
249	688169	石头科技	34,897	28,371,261.00	0.10
250	601990	南京证券	2,856,419	28,307,112.29	0.10
251	300676	华大基因	317,506	27,877,026.80	0.10
252	002044	美年健康	3,550,711	27,873,081.35	0.10
253	603260	合盛硅业	210,700	27,806,079.00	0.10
254	600872	中炬高新	722,056	27,416,466.32	0.09
255	600061	国投资本	3,325,027	27,331,721.94	0.09
256	002600	领益智造	3,659,450	26,933,552.00	0.09
257	601021	春秋航空	472,156	26,818,460.80	0.09
258	000708	中信特钢	1,306,462	26,756,341.76	0.09
259	600845	宝信软件	437,442	26,609,596.86	0.09
260	601878	浙商证券	2,007,100	26,453,578.00	0.09
261	601728	中国电信	6,026,421	26,070,762.27	0.09
262	600161	天坛生物	890,752	25,796,177.92	0.09
263	603939	益丰药房	462,800	25,504,908.00	0.09
264	300558	贝达药业	318,305	25,410,288.15	0.09
265	603338	浙江鼎力	310,200	24,896,652.00	0.09
266	688126	沪硅产业	958,612	24,751,361.84	0.09
267	600018	上港集团	4,515,939	24,747,345.72	0.09
268	601696	中银证券	1,794,855	24,140,799.75	0.08
269	601216	君正集团	4,363,466	22,820,927.18	0.08
270	601162	天风证券	5,601,500	22,686,075.00	0.08

271	688396	华润微	345,321	22,307,736.60	0.08
272	300866	安克创新	212,600	21,791,500.00	0.08
273	600606	绿地控股	4,962,209	21,535,987.06	0.07
274	600655	豫园股份	2,012,965	20,733,539.50	0.07
275	601995	中金公司	413,338	20,265,962.14	0.07
276	002024	苏宁易购	4,816,388	19,843,518.56	0.07
277	002157	正邦科技	2,037,242	19,679,757.72	0.07
278	688363	华熙生物	125,492	19,488,907.60	0.07
279	601933	永辉超市	4,689,408	18,992,102.40	0.07
280	002607	中公教育	2,390,800	18,791,688.00	0.07
281	002064	华峰化学	1,798,300	18,774,252.00	0.06
282	601881	中国银河	1,665,500	18,636,945.00	0.06
283	600848	上海临港	1,237,804	18,406,145.48	0.06
284	601998	中信银行	3,964,678	18,316,812.36	0.06
285	601319	中国人保	3,670,500	17,251,350.00	0.06
286	603233	大参林	406,478	17,116,788.58	0.06
287	603195	公牛集团	102,245	17,105,588.50	0.06
288	688009	中国通号	3,346,242	16,664,285.16	0.06
289	603658	安图生物	299,444	16,487,386.64	0.06
290	603087	甘李药业	220,300	15,495,902.00	0.05
291	600025	华能水电	2,325,068	15,322,198.12	0.05
292	601898	中煤能源	2,364,900	14,875,221.00	0.05
293	601236	红塔证券	1,219,256	14,533,531.52	0.05
294	601231	环旭电子	859,768	13,807,874.08	0.05
295	002032	苏泊尔	211,581	13,168,801.44	0.05
296	000800	一汽解放	1,203,400	12,382,986.00	0.04
297	601808	中海油服	767,118	11,506,770.00	0.04
298	605499	东鹏饮料	57,600	10,473,984.00	0.04
299	300888	稳健医疗	111,600	9,201,420.00	0.03
300	601698	中国卫通	568,238	8,176,944.82	0.03
301	600703	三安光电	136,787	5,137,719.72	0.02
302	601727	上海电气	1,045,034	5,078,865.24	0.02
303	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.00
304	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.00
305	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.00
306	688553	汇宇制药	8,928	286,678.08	0.00
307	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
308	688787	海天瑞声	817	71,364.95	0.00
309	688272	富吉瑞	1,263	49,370.67	0.00
310	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
311	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
312	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
313	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
314	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00

315	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
316	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
317	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
318	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
319	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
320	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
321	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
322	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
323	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
324	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
325	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
326	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
327	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
328	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
329	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
330	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
331	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
332	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
333	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
334	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
335	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
336	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
337	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
338	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
339	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
340	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
341	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
342	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
343	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
344	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
345	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
346	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
347	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
348	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
349	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
350	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
351	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
352	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
353	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
354	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
355	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
356	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
357	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
358	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00

359	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
360	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
361	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,214,038,125.87	3.97
2	000858	五粮液	776,678,432.93	2.54
3	000333	美的集团	583,163,620.04	1.91
4	002415	海康威视	410,686,988.42	1.34
5	600519	贵州茅台	379,499,614.15	1.24
6	300059	东方财富	376,831,862.77	1.23
7	000651	格力电器	364,657,137.19	1.19
8	000568	泸州老窖	305,404,784.69	1.00
9	002594	比亚迪	301,044,612.99	0.98
10	000001	平安银行	300,094,601.79	0.98
11	002475	立讯精密	298,500,320.82	0.98
12	000725	京东方 A	292,757,759.97	0.96
13	000661	长春高新	267,237,863.02	0.87
14	000002	万科 A	251,946,580.63	0.82
15	300122	智飞生物	249,967,781.92	0.82
16	300760	迈瑞医疗	241,999,551.17	0.79
17	002714	牧原股份	237,816,022.82	0.78
18	300015	爱尔眼科	222,977,210.01	0.73
19	300274	阳光电源	220,585,454.25	0.72
20	002142	宁波银行	213,153,597.78	0.70

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	926,246,574.08	3.03
2	000333	美的集团	694,648,166.03	2.27
3	300059	东方财富	444,809,558.52	1.45
4	000651	格力电器	439,041,106.76	1.44
5	002415	海康威视	401,216,099.91	1.31
6	002594	比亚迪	365,886,654.67	1.20

7	000001	平安银行	356,272,378.14	1.16
8	000568	泸州老窖	349,335,076.71	1.14
9	002475	立讯精密	316,183,251.27	1.03
10	000725	京东方 A	312,042,990.30	1.02
11	000002	万科 A	299,586,127.76	0.98
12	000661	长春高新	285,382,557.72	0.93
13	002714	牧原股份	277,506,809.34	0.91
14	600519	贵州茅台	260,403,817.05	0.85
15	300122	智飞生物	239,985,098.51	0.78
16	300014	亿纬锂能	233,408,980.12	0.76
17	002352	顺丰控股	226,315,669.22	0.74
18	300015	爱尔眼科	214,313,678.99	0.70
19	002460	赣锋锂业	210,481,136.99	0.69
20	002371	北方华创	207,804,628.22	0.68

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	18,550,048,678.17
卖出股票收入（成交）总额	18,544,715,294.40

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。

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）（手）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
----	----	-------------	---------	-----------	------

IF2203	沪深 300 股指期货 IF2203 合约	145	215,351,100.00	-2,749,200.00	买入股指期货合约的目的是进行更有效地流动性管理，实现投资目标。
公允价值变动总额合计（元）					-2,749,200.00
股指期货投资本期收益（元）					12,762,171.84
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-16,934,820.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，兴业银行、招商银行系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,128,180.22
2	应收证券清算款	111,273,067.79
3	应收股利	2,024.70
4	应收利息	1,563,446.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	139,966,719.62
---	----	----------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300059	东方财富	90,863,835.00	0.31	转融通出借证券受限
2	000858	五 粮 液	57,624,408.00	0.20	转融通出借证券受限
3	601012	隆基股份	56,271,360.00	0.19	转融通出借证券受限
4	600036	招商银行	54,214,230.00	0.19	转融通出借证券受限
5	000333	美的集团	44,536,954.00	0.15	转融通出借证券受限
6	601318	中国平安	44,199,488.00	0.15	转融通出借证券受限
7	600519	贵州茅台	41,000,000.00	0.14	转融通出借证券受限
8	601166	兴业银行	20,087,200.00	0.07	转融通出借证券受限
9	600900	长江电力	13,511,040.00	0.05	转融通出借证券受限
10	300750	宁德时代	9,172,800.00	0.03	转融通出借证券受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

89 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏沪深 300ETF 联接	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例

18,460	311,990.78	3,392,045,224.00	58.90%	225,359,013.00	3.91%	2,141,945,591.00	37.19%
--------	------------	------------------	--------	----------------	-------	------------------	--------

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金投资有限责任公司	1,790,942,652.00	31.10%
2	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	414,882,219.00	7.20%
3	广发证券股份有限公司	202,543,906.00	3.52%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	94,793,200.00	1.65%
5	中海信托股份有限公司—金海 1 号证券投资集合资金信托	78,676,500.00	1.37%
6	中信证券—工行—中信证券贵宾定制 7 号集合资产管理计划	76,141,500.00	1.32%
7	方正中期期货有限公司—方正中期稳盈 1 号资产管理计划	68,020,700.00	1.18%
8	中信证券股份有限公司	60,540,609.00	1.05%
9	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	49,168,800.00	0.85%
10	中国人寿保险股份有限公司	45,134,768.00	0.78%
11	中国工商银行股份有限公司—华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,141,945,591.00	37.19%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产份额总量的数量区间（万份）
张弘弢	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	0

	合计	0~10
--	----	------

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012 年 12 月 25 日)基金份额总额	602,808,845
本报告期期初基金份额总额	5,764,749,828
本报告期基金总申购份额	5,657,400,000
减：本报告期基金总赎回份额	5,662,800,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,759,349,828

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 4 月 9 日发布公告，郑煜女士、孙彬先生担任华夏基金管理有限公司副总经理，蔡向阳先生担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

本基金管理人于 2021 年 11 月 2 日发布公告，蔡向阳先生不再担任华夏基金管理有限公司高级管理人员。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 130,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 9 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处

罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	15,605,294,216.87	42.12%	1,268,889.80	42.11%	-
国泰君安证券	2	11,759,259,312.02	31.74%	956,059.62	31.73%	-
中信证券	6	7,190,392,442.09	19.41%	584,731.07	19.41%	-
中国银河证券	4	2,063,233,314.18	5.57%	167,748.43	5.57%	-
中金公司	3	433,520,034.51	1.17%	35,839.17	1.19%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了长江证券、东北证券、东方证券、方正证券、广发证券、国金证券、国盛证券、华安证券、上海证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、粤开证券、中金财富、中泰证券、中投证券、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，国泰君安证券、中信证券的部分交易单元、广发证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，国金证券的部分交易单元为本期剔除的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	
	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
招商证券	27,300,600.76	32.99%	50,000,000.00	71.43%
国泰君安证券	3,737,064.03	4.52%	-	-
中信证券	44,309,112.00	53.55%	20,000,000.00	28.57%
中国银河证券	-	-	-	-
中金公司	7,403,082.10	8.95%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-04
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-04
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-09
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
5	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金利润分配公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-19
6	华夏基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-27
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-01
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-24
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
11	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修订旗下部分公募基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2021-04-07

	联方承销证券的公告	网站	
14	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
15	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-09
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
17	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-08
18	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-13
20	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-19
21	华夏基金管理有限公司关于深圳分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-25
22	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
24	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-09
25	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-17
26	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18
27	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-19
28	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-30
29	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-03
30	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-14
31	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-23
32	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-24
33	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-07-26
34	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-05
35	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2021-08-07

	关联方承销证券的公告	网站	
36	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-13
37	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-13
38	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-15
39	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-20
40	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-22
41	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-10-23
42	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-02
43	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-10
44	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-11-22
45	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-04
46	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-08
47	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-10

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021-01-01 至 2021-12-31	1,790,942,652.00	-	-	1,790,942,652.00	31.10%
华夏沪深 300ETF 联接	1	2021-01-01 至 2021-12-31	2,156,915,291.00	309,901,400.00	324,871,100.00	2,141,945,591.00	37.19%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规							

模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日