
华夏中证 5G 通信主题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
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 审计报告.....	13
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告.....	199
8.1 期末基金资产组合情况.....	200
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	200
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.....	201
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	203
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	205
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.....	205
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.....	205
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.....	205
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.....	205
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	205
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	205
8.12 投资组合报告附注.....	206
§9 基金份额持有人信息.....	207
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	207
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	207
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	208
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.....	208
§10 开放式基金份额变动.....	208
§11 重大事件揭示.....	208
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	213
§13 备查文件目录.....	213

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证 5G 通信主题 ETF
场内简称	5GETF（扩位证券简称：5GETF）
基金主代码	515050
交易代码	515050
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 17 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,247,068,476.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 10 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、衍生品投资策略、债券投资策略等。
业绩比较基准	中证 5G 通信主题指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66596688
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联	www.ChinaAMC.com

网网址	
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 9 月 17 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-161,611,400.34	1,457,212,784.33	42,775,540.19
本期利润	969,783,723.32	1,365,653,255.53	71,931,092.43
加权平均基金份额本期利润	0.0665	0.0721	0.0147
本期加权平均净值利润率	5.90%	6.06%	1.50%
本期基金份额净值增长率	6.49%	19.22%	-0.29%
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	1,326,887,820.10	2,482,888,686.65	-22,385,120.38
期末可供分配基金份额利润	0.1435	0.1408	-0.0029
期末基金资产净值	11,705,609,159.73	20,965,987,585.54	7,676,683,355.62
期末基金份额净值	1.2659	1.1887	0.9971
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	26.59%	18.87%	-0.29%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

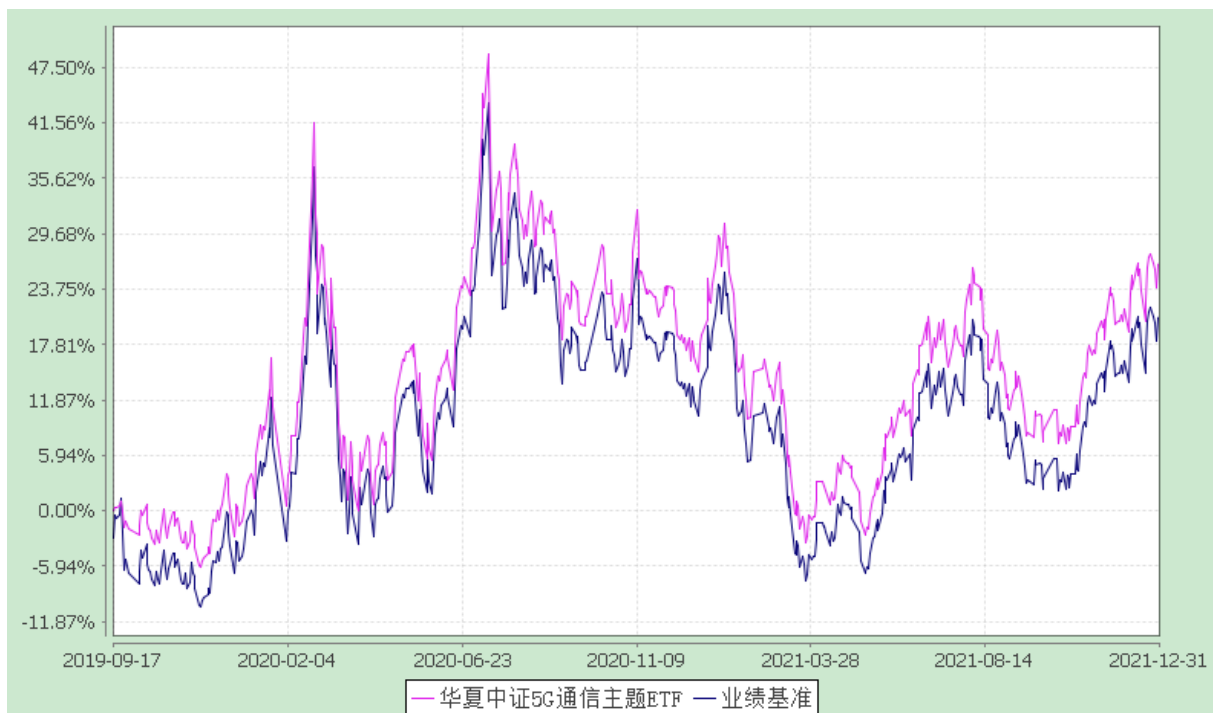
		②		准差④		
过去三个月	16.68%	1.42%	16.89%	1.43%	-0.21%	-0.01%
过去六个月	4.77%	1.48%	4.50%	1.50%	0.27%	-0.02%
过去一年	6.49%	1.57%	6.05%	1.59%	0.44%	-0.02%
自基金合同生效起至今	26.59%	1.95%	20.86%	2.00%	5.73%	-0.05%

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

华夏中证 5G 通信主题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

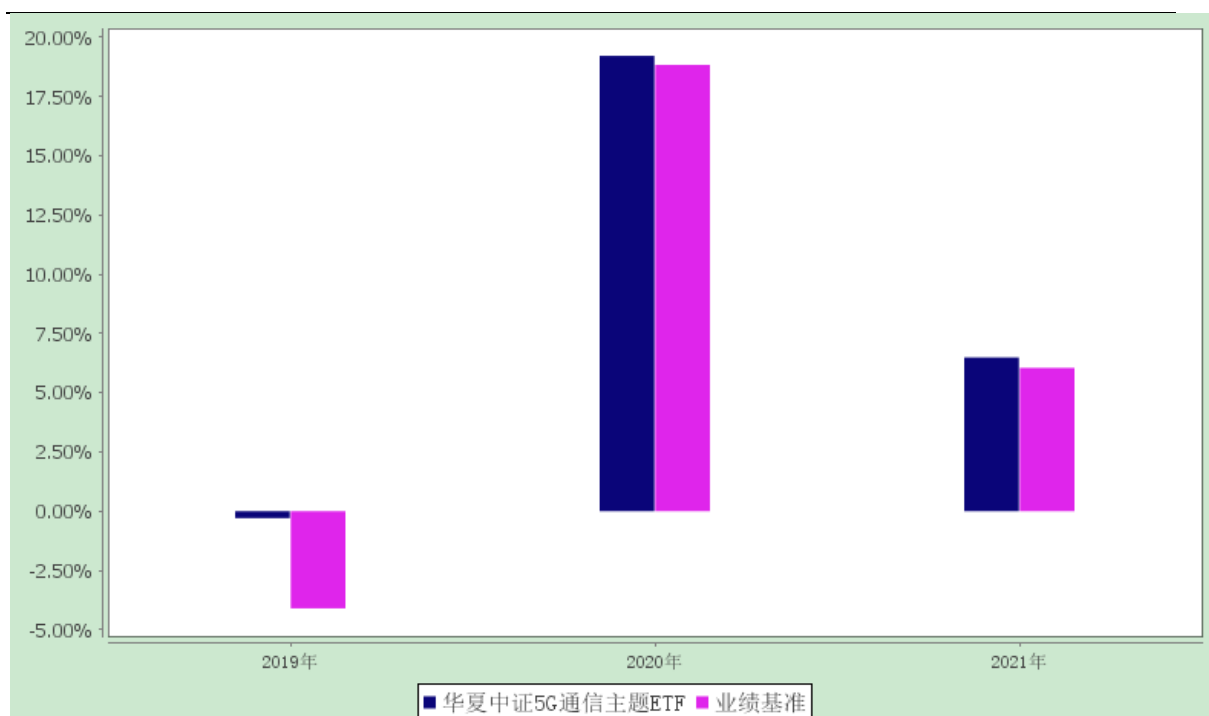
(2019 年 9 月 17 日至 2021 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来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

华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2019 年 9 月 17 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

§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		
李俊	本基金的基金经理	2019-09-17	-	13 年	硕士。曾任职于北京市金杜律师事务所证券部。2008 年 12 月加入华夏基金管理有限公司。曾任数量投资部研究员、基金经理助理。

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 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中证 5G 通信主题指数,该指数选取产品和业务与 5G 通信技术相关的上市公司作为样本股,包括但不限于电信服务、通信设备、计算机及电子设备和计算机运用等细分

行业，旨在反映相关领域的 A 股上市公司整体表现。本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

2021 年，国际方面，疫情依然没有结束，部分国家出现了变种病毒，与此同时，通胀持续超出预期，美国 12 月 CPI 同比增长 7%，创下近 40 年来新高。面对持续高企的通胀，至少在当前时点下，高通胀已成为美联储的“头号敌人”，通过加速 Taper 并改变对通胀的立场，美联储试图为提前加息提供空间。而受困于高通胀，英国央行已先于美联储加息，在此之前，俄罗斯、巴西、土耳其乃至韩国等国已经率先加息。国内方面，疫情虽有反复，但已基本控制，整体经济韧性较强。出口持续超预期，但在供给冲击、需求收缩、预期转弱的三重压力下，经济短期面临较大压力。中央经济工作会议强调经济要稳字当头、稳中求进。这也成为现阶段货币政策、财政政策的主基调。

市场方面，鉴于全年经济恢复一波三折、通胀数据居高不下、货币政策顾虑重重，这种艰难与纠结下，2021 年市场整体呈震荡走势。

年初市场延续之前的乐观情绪一路上攻，但在农历年后，随着十年期美债收益率超预期上涨、拜登政府经济刺激方案出台，市场对于通胀的预期、对于未来可能的宽松政策退出的担忧明显加剧，市场经历了一波较深幅度的调整；随后美联储表态通胀压力是暂时的，并继续维持宽松的货币政策，风险偏好逐渐抬升，市场重拾上涨；但国内经济类滞涨与信用收缩的担忧终究抑制了市场情绪，在个别地产公司债务问题发酵、限电限产一刀切担忧等因素影响下，市场风险偏好再次走弱，虽然国内政策逐渐走向宽松，但随着美国通胀持续创下历史新高并成为美联储不得不重视的头等风险后，对市场情绪也形成较大抑制。纵观全年，市场整体呈震荡格局，但资产荒依然是当下的重要特征，在一些较为确定的板块，仍然会阶段性地出现结构性投资机会。

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

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，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包括中信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、申万宏源证券有限公司、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 1.2659 元，本报告期份额净值增长率为 6.49%，同期业绩比较基准增长率 6.05%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.44%，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，世界范围内，疫情下的经济恢复、通胀、债务状况，以及相应的政策抉择，是未来需要重点关注的因素。就中短期而言，海外流动性收敛是较为明确的主线。

国内方面，就短期而言，政策依然是边际放松，全年预计是稳中有进。

所谓稳主要是由于经济增长的压力依然较大，投资、消费后继乏力，至少在上半年，财政、产业等稳增长政策将密集出台。而从更长时间的视角看，我国当下处于经济转型的关键期，从国际上看，当前时点又处于重要的战略机遇期，因此，稳增长在举措与节奏上是需要密切关注的。

所谓进，则是我们的政策在考虑短期的稳之外，更需要关注的是我们长期的空间与动力，我们的人口问题、我们在世界经济分工中的定位问题、我们经济的持续发展动能问题，而这些则需要我们主动打破而不是哪怕被动地强化既有的沉疴旧疾，依靠科技创新，为经济长远发展提供长久的内生动力。

就市场而言，如果经济能够维持稳定或政府出台超预期的改革或提振市场的政策，市场或有较好的表现。

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

珍惜基金份额持有人的每一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人员的职责，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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

普华永道中天审字（2022）第 24712 号

华夏中证 5G 通信主题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

我们审计了华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏中证 5G 通信主题 ETF”)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,公允反映了华夏中证 5G 通信主题 ETF 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,我们独立于华夏中证 5G 通信主题 ETF,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

华夏中证 5G 通信主题 ETF 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中证 5G 通信主题 ETF 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中证 5G 通信主题 ETF、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中证 5G 通信主题 ETF 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，就可能导致对华夏中证 5G 通信主题 ETF 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中证 5G 通信主题 ETF 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：华夏中证 5G 通信主题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	26,640,231.38	61,776,042.08
结算备付金		31,223,177.06	138,197,105.83
存出保证金		4,445,987.43	5,989,313.25
交易性金融资产	7.4.7.2	11,673,595,764.14	20,784,784,661.79
其中：股票投资		11,673,595,764.14	20,784,784,661.79
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		10,007,133.53	85,939,996.12
应收利息	7.4.7.5	431,736.60	945,584.42
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		11,746,344,030.14	21,077,632,703.49
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		7,273,184.17	53,039,730.23

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,307,423.08	8,965,258.40
应付托管费		1,061,484.64	1,793,051.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,103,802.41	10,350,454.84
应交税费		48,949.66	63,426.11
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	23,940,026.45	37,433,196.67
负债合计		40,734,870.41	111,645,117.95
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	9,247,068,476.00	17,637,068,476.00
未分配利润	7.4.7.10	2,458,540,683.73	3,328,919,109.54
所有者权益合计		11,705,609,159.73	20,965,987,585.54
负债和所有者权益总计		11,746,344,030.14	21,077,632,703.49

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2659 元，基金份额总额 9,247,068,476.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华夏中证 5G 通信主题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		1,108,427,211.22	1,618,615,384.20
1.利息收入		27,404,290.32	11,729,228.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,089,387.78	4,063,996.16
债券利息收入		3,467.30	29,520.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,013.70	-
证券出借利息收入		25,288,421.54	7,635,711.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-95,481,209.73	1,632,014,406.66
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-209,307,963.55	1,454,562,802.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	17,146,214.09	65,575,388.12
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	-	-

股利收益	7.4.7.16	96,680,539.73	111,876,216.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,131,395,123.66	-91,559,528.80
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	45,109,006.97	66,431,277.79
减：二、费用		138,643,487.90	252,962,128.67
1. 管理人报酬		82,442,476.87	111,130,983.29
2. 托管费		16,488,495.28	22,226,196.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	34,385,486.53	112,586,422.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		80,688.56	22,995.76
7. 其他费用	7.4.7.20	5,246,340.66	6,995,530.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		969,783,723.32	1,365,653,255.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		969,783,723.32	1,365,653,255.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证 5G 通信主题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）	17,637,068,476.00	3,328,919,109.54	20,965,987,585.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	969,783,723.32	969,783,723.32
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）	-8,390,000,000.00	-1,840,162,149.13	-10,230,162,149.13
其中：1.基金申购款	8,232,000,000.00	985,834,600.62	9,217,834,600.62
2.基金赎回款	-16,622,000,000.00	-2,825,996,749.75	-19,447,996,749.75
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	9,247,068,476.00	2,458,540,683.73	11,705,609,159.73

金净值)			
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)	7,699,068,476.00	-22,385,120.38	7,676,683,355.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,365,653,255.53	1,365,653,255.53
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)	9,938,000,000.00	1,985,650,974.39	11,923,650,974.39
其中: 1.基金申购款	61,659,500,000.00	10,826,829,087.18	72,486,329,087.18
2.基金赎回款	-51,721,500,000.00	-8,841,178,112.79	-60,562,678,112.79
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	17,637,068,476.00	3,328,919,109.54	20,965,987,585.54

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

华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1373 号《关于准予华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2019 年 8 月 30 日至 2019 年 9 月 9 日共募集 4,152,568,476.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2019）验字第 60739337_A61 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 9 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基

基金份额总额为 4,152,568,476.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

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中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。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	26,640,231.38	61,776,042.08
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	26,640,231.38	61,776,042.08

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		10,604,604,617.04	11,673,595,764.14	1,068,991,147.10
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		10,604,604,617.04	11,673,595,764.14	1,068,991,147.10
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		20,847,188,638.35	20,784,784,661.79	-62,403,976.56
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		20,847,188,638.35	20,784,784,661.79	-62,403,976.56

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

无。

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	3,232.47	10,551.44
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	16,246.02	57,916.06
应收债券利息	-	-
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	410,057.34	874,152.20
其他	2,200.77	2,964.72
合计	431,736.60	945,584.42

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	3,103,802.41	10,350,454.84
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,103,802.41	10,350,454.84

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	230,000.00	250,000.00
应付指数使用费	1,013,467.76	1,580,552.48
应退替代款	22,690,004.24	35,595,262.64
可退替代款	6,554.45	7,381.55
合计	23,940,026.45	37,433,196.67

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	17,637,068,476.00	17,637,068,476.00
本期申购	8,232,000,000.00	8,232,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-16,622,000,000.00	-16,622,000,000.00
本期末	9,247,068,476.00	9,247,068,476.00

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	2,482,888,686.65	846,030,422.89	3,328,919,109.54
本期利润	-161,611,400.34	1,131,395,123.66	969,783,723.32
本期基金份额交易产生的变动数	-994,389,466.21	-845,772,682.92	-1,840,162,149.13
其中：基金申购款	1,185,388,659.38	-199,554,058.76	985,834,600.62
基金赎回款	-2,179,778,125.59	-646,218,624.16	-2,825,996,749.75

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,326,887,820.10	1,131,652,863.63	2,458,540,683.73

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	249,685.39	913,731.16
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	1,773,863.31	2,901,689.49
其他	65,839.08	248,575.51
合计	2,089,387.78	4,063,996.16

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	-367,598,048.27	1,502,240,237.66
股票投资收益——赎回差价收入	158,290,084.72	-47,677,435.12
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-209,307,963.55	1,454,562,802.54

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	18,753,208,819.66	52,730,615,931.78
减：卖出股票成本总额	19,120,806,867.93	51,228,375,694.12
买卖股票差价收入	-367,598,048.27	1,502,240,237.66

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	19,447,996,749.75	60,562,678,112.79

减：现金支付赎回款总额	14,975,327,054.75	46,743,958,734.79
减：赎回股票成本总额	4,314,379,610.28	13,866,396,813.12
赎回差价收入	158,290,084.72	-47,677,435.12

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	71,731,785.40	171,888,882.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	54,582,000.00	106,282,900.00
减：应收利息总额	3,571.31	30,594.63
买卖债券差价收入	17,146,214.09	65,575,388.12

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

无。

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	96,680,539.73	111,876,216.00
其中：证券出借权益补偿收入	6,789,975.74	1,935,209.04
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	96,680,539.73	111,876,216.00

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	1,131,395,123.66	-91,559,528.80
——股票投资	1,131,395,123.66	-91,559,528.80
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,131,395,123.66	-91,559,528.80

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	-	-
替代损益	45,109,006.97	66,430,806.02
其他	-	471.77
合计	45,109,006.97	66,431,277.79

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	34,385,486.53	112,586,422.09
银行间市场交易费用	-	-
合计	34,385,486.53	112,586,422.09

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	110,000.00	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	69,792.06	77,271.84
指数使用费	4,946,548.60	6,667,858.96
其他	-	400.00
合计	5,246,340.66	6,995,530.80

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

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	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
华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏中证 5G 通信主题 ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信中证资本管理有限公司（“中信中证资本”）	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	14,694,639,594.98	49.21%	29,723,833,116.42	25.95%

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	19,664,159.00	27.41%	11,979,753.40	6.97%

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	40,000,000.00	100.00%	-	-

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	6,337,827.00	49.21%	646,798.52	20.84%
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	12,819,939.90	25.85%	3,356,525.88	32.43%

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	82,442,476.87	111,130,983.29
其中：支付销售机构的客户维护费	1,505,971.77	4,468,901.40

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 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托管费	16,488,495.28	22,226,196.73

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	3,169,522,960.95	2,546,956.84	198,984,447.36	41,721.27
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	1,036,267,632.90	1,174,851.08	111,612,423.00	47,841.40

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	2021010400013682	硕贝德	2021-01-04	738,234.00	55,800.00	28	6.00	3,445.09	-	-
中信证券	2021010400013684	大富科技	2021-01-04	209,200.00	20,000.00	14	3.50	284.74	-	-
中信证券	2021010400013686	光弘科技	2021-01-04	721,990.00	52,700.00	28	4.10	2,302.35	-	-
中信证券	2021010400013688	光弘科技	2021-01-04	171,250.00	12,500.00	14	4.20	279.71	-	-
中信证券	2021010400013690	光弘科技	2021-01-04	228,790.00	16,700.00	14	4.20	373.69	-	-
中信证券	2021010400013692	硕贝德	2021-01-04	661,500.00	50,000.00	14	6.10	1,569.23	-	-
中信	2021010400013818	光弘	2021-01-04	171,250.00	12,500.00	14	3.30	219.77	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021010400013 820	大 富 科 技	2021-01- 04	523,000.00	50,000.00	14	3.90	793.22	-	-
中 信 证 券	2021010400013 822	光 弘 科 技	2021-01- 04	689,110.00	50,300.00	28	3.20	1,715.12	-	-
中 信 证 券	2021010400013 824	电 连 技 术	2021-01- 04	977,482.00	28,300.00	28	4.40	3,345.16	-	-
中 信 证 券	2021010500000 575	蓝 思 科 技	2021-01- 05	344,700.00	10,000.00	28	3.70	991.97	-	-
中 信 证 券	2021010500010 268	信 维 通 信	2021-01- 05	457,320.00	12,000.00	28	3.20	1,138.22	-	-
中 信 证 券	2021010500010 270	电 连 技 术	2021-01- 05	364,875.00	10,500.00	28	4.40	1,248.68	-	-
中 信 证 券	2021010500010 272	硕 贝 德	2021-01- 05	665,500.00	50,000.00	14	4.50	1,164.63	-	-
中 信 证 券	2021010500010 274	光 弘 科 技	2021-01- 05	1,380,000.0 0	100,000.0 0	14	3.30	1,771.00	-	-
中 信 证 券	2021010500010 276	光 弘 科 技	2021-01- 05	634,800.00	46,000.00	14	3.30	814.66	-	-
中 信 证 券	2021010500010 278	电 连 技 术	2021-01- 05	1,737,500.0 0	50,000.00	14	4.50	3,040.63	-	-
中 信 证 券	2021010500010 280	信 维 通 信	2021-01- 05	381,100.00	10,000.00	14	3.30	489.08	-	-

券		信								
中信 证券	2021010700012 528	大富 科技	2021-01- 07	360,234.00	37,800.00	28	3.80	1,064.69	-	-
中信 证券	2021010700012 530	天孚 通信	2021-01- 07	848,992.00	17,200.00	28	4.40	2,905.44	-	-
中信 证券	2021011200006 221	蓝思 科技	2021-01- 12	1,120,500.0 0	30,000.00	14	3.80	1,655.85	-	-
中信 证券	2021011200006 223	广和 通	2021-01- 12	651,200.00	10,000.00	14	4.60	1,164.92	-	-
中信 证券	2021011200006 225	光弘 科技	2021-01- 12	273,400.00	20,000.00	28	3.20	680.46	-	-
中信 证券	2021011200006 227	光弘 科技	2021-01- 12	136,700.00	10,000.00	14	3.30	175.43	-	-
中信 证券	2021011200006 229	蓝思 科技	2021-01- 12	1,120,500.0 0	30,000.00	14	3.80	1,655.85	-	-
中信 证券	2021011400009 811	新易 盛	2021-01- 14	668,400.00	12,000.00	28	3.60	2,339.40	-	-
中信 证券	2021011400009 813	光弘 科技	2021-01- 14	284,800.00	20,000.00	28	3.20	886.05	-	-
中信 证券	2021011400009 815	长盈 精密	2021-01- 14	388,864.00	12,400.00	14	3.60	544.41	-	-
中信 证券	2021011400009 817	广和 通	2021-01- 14	660,000.00	10,000.00	14	4.60	1,180.67	-	-

中信证券	2021011800008704	光弘科技	2021-01-18	178,875.00	12,500.00	14	3.40	236.51	-	-
中信证券	2021011800008706	大富科技	2021-01-18	518,500.00	50,000.00	14	3.40	685.57	-	-
中信证券	2021011800008708	光弘科技	2021-01-18	238,977.00	16,700.00	14	3.40	315.98	-	-
中信证券	2021011800008710	光弘科技	2021-01-18	178,875.00	12,500.00	14	3.40	236.51	-	-
中信证券	2021011800008712	硕贝德	2021-01-18	630,000.00	50,000.00	14	4.60	1,127.00	-	-
中信证券	2021011800008714	大富科技	2021-01-18	207,400.00	20,000.00	14	3.40	274.23	-	-
中信证券	2021011900000336	中科创达	2021-01-19	2,010,400.00	14,000.00	14	3.30	2,580.01	-	-
中信证券	2021011900007568	电连技术	2021-01-19	1,579,500.00	50,000.00	14	3.70	2,272.73	-	-
中信证券	2021011900007570	信维通信	2021-01-19	401,800.00	10,000.00	14	3.50	546.89	-	-
中信证券	2021011900007602	硕贝德	2021-01-19	634,500.00	50,000.00	14	4.60	1,135.05	-	-
中信证券	2021011900007604	光弘科技	2021-01-19	651,360.00	46,000.00	14	3.40	861.24	-	-
中	2021011900007	光	2021-01-	1,416,000.0	100,000.0	14	3.40	1,872.27	-	-

信 证 券	606	弘 科 技	19	0	0					
中 信 证 券	2021012600000 550	蓝 思 科 技	2021-01- 26	1,053,300.0 0	30,000.00	14	3.80	1,556.54	-	-
中 信 证 券	2021012600006 560	广 和 通	2021-01- 26	612,800.00	10,000.00	14	4.30	1,024.74	-	-
中 信 证 券	2021012600006 562	蓝 思 科 技	2021-01- 26	379,188.00	10,800.00	28	3.70	1,091.22	-	-
中 信 证 券	2021012600006 564	硕 贝 德	2021-01- 26	4,053,000.0 0	350,000.0 0	28	3.70	11,663.63	-	-
中 信 证 券	2021012600006 566	光 弘 科 技	2021-01- 26	132,900.00	10,000.00	14	3.50	180.89	-	-
中 信 证 券	2021012600006 572	蓝 思 科 技	2021-01- 26	1,053,300.0 0	30,000.00	14	3.80	1,556.54	-	-
中 信 证 券	2021012600006 574	蓝 思 科 技	2021-01- 26	1,053,300.0 0	30,000.00	14	3.80	1,556.54	-	-
中 信 证 券	2021012800000 619	蓝 思 科 技	2021-01- 28	3,300,000.0 0	100,000.0 0	28	3.70	9,496.67	-	-
中 信 证 券	2021012800010 136	蓝 思 科 技	2021-01- 28	4,319,700.0 0	130,900.0 0	28	3.70	12,431.14	-	-
中 信 证 券	2021012800010 138	广 和 通	2021-01- 28	570,100.00	10,000.00	14	4.30	1,430.00	-	-
中 信	2021020100009 050	大 富	2021-02- 01	504,500.00	50,000.00	14	3.50	833.83	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021020100009 082	大 富 科 技	2021-02- 01	201,800.00	20,000.00	14	3.50	333.53	-	-
中 信 证 券	2021020100009 098	硕 贝 德	2021-02- 01	609,894.00	55,800.00	28	3.60	1,707.70	-	-
中 信 证 券	2021020100009 102	硕 贝 德	2021-02- 01	546,500.00	50,000.00	14	3.70	954.85	-	-
中 信 证 券	2021020100009 122	电 连 技 术	2021-02- 01	908,147.00	28,300.00	28	3.60	2,542.81	-	-
中 信 证 券	2021020100009 124	光 弘 科 技	2021-02- 01	209,919.00	16,700.00	14	3.70	366.78	-	-
中 信 证 券	2021020100009 126	光 弘 科 技	2021-02- 01	662,439.00	52,700.00	28	3.60	1,854.83	-	-
中 信 证 券	2021020100009 206	光 弘 科 技	2021-02- 01	157,125.00	12,500.00	14	3.70	274.54	-	-
中 信 证 券	2021020100009 208	光 弘 科 技	2021-02- 01	632,271.00	50,300.00	28	3.60	1,770.36	-	-
中 信 证 券	2021020200000 733	光 弘 科 技	2021-02- 02	441,700.00	35,000.00	28	4.20	1,442.89	-	-
中 信 证 券	2021020200000 735	光 环 新 网	2021-02- 02	215,400.00	12,000.00	28	3.40	569.61	-	-
中 信 证 券	2021020200000 737	广 和 通	2021-02- 02	835,800.00	14,000.00	28	4.20	2,730.28	-	-

券										
中信证券	2021020200000753	新易盛	2021-02-02	1,706,240.00	32,000.00	28	3.20	4,246.64	-	-
中信证券	2021020200000763	信维通信	2021-02-02	875,840.00	28,000.00	28	3.40	2,316.11	-	-
中信证券	20210202000008715	信维通信	2021-02-02	312,800.00	10,000.00	14	3.60	500.48	-	-
中信证券	20210202000008841	信维通信	2021-02-02	375,360.00	12,000.00	28	3.50	1,021.81	-	-
中信证券	20210202000008847	硕贝德	2021-02-02	542,000.00	50,000.00	14	3.70	891.29	-	-
中信证券	20210202000008853	蓝思科技	2021-02-02	324,000.00	10,000.00	28	3.70	932.40	-	-
中信证券	20210202000008857	电连技术	2021-02-02	1,675,000.00	50,000.00	14	3.70	2,754.45	-	-
中信证券	20210202000008979	光弘科技	2021-02-02	1,262,000.00	100,000.00	14	3.70	2,075.29	-	-
中信证券	20210202000008981	电连技术	2021-02-02	351,750.00	10,500.00	28	3.60	984.90	-	-
中信证券	20210204000014907	天孚通信	2021-02-04	725,840.00	17,200.00	28	4.50	2,540.44	-	-
中信证券	20210204000014909	大富科技	2021-02-04	350,784.00	37,800.00	28	3.40	927.63	-	-

中信证券	2021020900006019	光弘科技	2021-02-09	116,200.00	10,000.00	14	4.30	194.31	-	-
中信证券	2021020900006021	广和通	2021-02-09	571,300.00	10,000.00	14	4.30	955.34	-	-
中信证券	2021020900006023	光弘科技	2021-02-09	232,400.00	20,000.00	28	4.20	759.17	-	-
中信证券	2021020900006341	蓝思科技	2021-02-09	930,000.00	30,000.00	14	4.60	1,663.67	-	-
中信证券	2021020900006343	蓝思科技	2021-02-09	930,000.00	30,000.00	14	4.60	1,663.67	-	-
中信证券	2021020900006347	蓝思科技	2021-02-09	930,000.00	30,000.00	14	4.60	1,663.67	-	-
中信证券	2021021800001195	蓝思科技	2021-02-18	1,319,790.00	41,000.00	28	4.00	4,106.01	-	-
中信证券	20210218000038576	信维通信	2021-02-18	333,300.00	10,000.00	14	3.50	453.66	-	-
中信证券	20210218000042966	光弘科技	2021-02-18	1,213,000.00	100,000.00	14	4.30	2,028.41	-	-
中信证券	20210218000042968	硕贝德	2021-02-18	529,000.00	50,000.00	14	4.30	884.61	-	-
中信证券	20210218000042970	光弘科技	2021-02-18	242,600.00	20,000.00	28	4.20	792.49	-	-
中	20210218000042	大	2021-02-	193,600.00	20,000.00	14	3.60	271.04	-	-

信 证 券	972	富 科 技	18							
中 信 证 券	2021021800042 974	电 连 技 术	2021-02- 18	1,487,000.0 0	50,000.00	14	4.30	2,486.59	-	-
中 信 证 券	2021021800042 976	大 富 科 技	2021-02- 18	484,000.00	50,000.00	14	3.60	677.60	-	-
中 信 证 券	2021021800042 978	光 弘 科 技	2021-02- 18	202,571.00	16,700.00	14	4.30	338.74	-	-
中 信 证 券	2021021800042 980	光 弘 科 技	2021-02- 18	151,625.00	12,500.00	14	4.30	253.55	-	-
中 信 证 券	2021021800042 982	硕 贝 德	2021-02- 18	529,000.00	50,000.00	14	4.30	884.61	-	-
中 信 证 券	2021021800042 984	广 和 通	2021-02- 18	581,000.00	10,000.00	14	4.30	971.56	-	-
中 信 证 券	2021021800042 986	新 易 盛	2021-02- 18	597,720.00	12,000.00	28	3.20	1,487.66	-	-
中 信 证 券	2021022300006 570	光 弘 科 技	2021-02- 23	119,900.00	10,000.00	14	4.30	200.50	-	-
中 信 证 券	2021022300006 584	蓝 思 科 技	2021-02- 23	934,500.00	30,000.00	14	4.10	1,490.01	-	-
中 信 证 券	2021022300006 586	蓝 思 科 技	2021-02- 23	934,500.00	30,000.00	14	4.10	1,490.01	-	-
中 信	2021022300006 588	广 和	2021-02- 23	555,200.00	10,000.00	14	4.30	928.42	-	-

证 券		通								
中 信 证 券	2021022300006 590	蓝 思 科 技	2021-02- 23	934,500.00	30,000.00	14	4.10	1,490.01	-	-
中 信 证 券	2021022300007 198	硕 贝 德	2021-02- 23	3,895,500.0 0	350,000.0 0	28	4.20	12,725.30	-	-
中 信 证 券	2021022300007 200	蓝 思 科 技	2021-02- 23	336,420.00	10,800.00	28	4.50	1,177.47	-	-
中 信 证 券	2021022400000 608	天 孚 通 信	2021-02- 24	455,300.00	10,000.00	28	3.60	1,274.84	-	-
中 信 证 券	2021022400000 610	信 维 通 信	2021-02- 24	307,620.00	9,000.00	28	3.30	789.56	-	-
中 信 证 券	2021022400000 614	天 孚 通 信	2021-02- 24	455,300.00	10,000.00	28	3.60	1,274.84	-	-
中 信 证 券	2021022500000 602	中 际 旭 创	2021-02- 25	9,562,000.0 0	200,000.0 0	28	3.10	23,055.04	-	-
中 信 证 券	2021022500000 608	蓝 思 科 技	2021-02- 25	495,300.00	15,600.00	28	3.50	1,348.32	-	-
中 信 证 券	2021022500000 612	蓝 思 科 技	2021-02- 25	495,300.00	15,600.00	14	3.60	693.42	-	-
中 信 证 券	2021022500000 618	光 环 新 网	2021-02- 25	201,000.00	10,000.00	14	3.40	265.77	-	-
中 信 证 券	2021022500004 707	蓝 思 科 技	2021-02- 25	4,156,075.0 0	130,900.0 0	28	4.00	12,930.01	-	-

券		技								
中信 证券	2021022500004 709	蓝 思 科 技	2021-02- 25	3,175,000.0 0	100,000.0 0	28	4.00	9,877.78	-	-
中信 证券	2021030200000 546	长 盈 精 密	2021-03- 02	619,835.00	26,500.00	14	3.40	819.56	-	-
中信 证券	2021030200000 552	蓝 思 科 技	2021-03- 02	550,872.00	16,800.00	28	3.30	1,413.90	-	-
中信 证券	2021030200000 554	蓝 思 科 技	2021-03- 02	468,897.00	14,300.00	14	3.40	619.99	-	-
中信 证券	2021030200004 643	信 维 通 信	2021-03- 02	403,920.00	12,000.00	28	3.30	1,036.73	-	-
中信 证券	2021030200004 645	信 维 通 信	2021-03- 02	942,480.00	28,000.00	28	3.30	2,419.03	-	-
中信 证券	2021030200005 099	光 环 新 网	2021-03- 02	235,080.00	12,000.00	28	3.30	603.37	-	-
中信 证券	2021030200005 101	蓝 思 科 技	2021-03- 02	327,900.00	10,000.00	28	3.50	892.62	-	-
中信 证券	2021030200005 105	广 和 通	2021-03- 02	749,280.00	14,000.00	28	4.30	2,505.93	-	-
中信 证券	2021030200005 109	电 连 技 术	2021-03- 02	332,535.00	10,500.00	28	3.50	905.23	-	-
中信 证券	2021030200005 111	新 易 盛	2021-03- 02	1,494,080.0 0	32,000.00	28	3.20	3,718.60	-	-

中信证券	2021030200005113	光弘科技	2021-03-02	428,750.00	35,000.00	28	3.50	1,167.15	-	-
中信证券	2021030400000533	光环新网	2021-03-04	241,302.00	13,100.00	14	3.60	337.82	-	-
中信证券	20210304000035003	光弘科技	2021-03-04	153,250.00	12,500.00	14	3.60	214.55	-	-
中信证券	20210304000035009	光弘科技	2021-03-04	1,226,000.00	100,000.00	14	3.60	1,716.40	-	-
中信证券	20210304000035011	电连技术	2021-03-04	1,649,000.00	50,000.00	14	3.60	2,308.60	-	-
中信证券	20210304000035015	广和通	2021-03-04	523,200.00	10,000.00	14	4.40	895.25	-	-
中信证券	20210304000035019	信维通信	2021-03-04	325,300.00	10,000.00	14	3.40	430.12	-	-
中信证券	20210309000007637	光弘科技	2021-03-09	122,800.00	10,000.00	14	3.30	157.59	-	-
中信证券	20210309000007651	蓝思科技	2021-03-09	864,900.00	30,000.00	14	3.40	1,143.59	-	-
中信证券	20210309000007653	蓝思科技	2021-03-09	864,900.00	30,000.00	14	3.40	1,143.59	-	-
中信证券	20210309000007655	蓝思科技	2021-03-09	864,900.00	30,000.00	14	3.40	1,143.59	-	-
中	20210309000007	光	2021-03-	245,600.00	20,000.00	28	3.20	611.27	-	-

信 证 券	657	弘 科 技	09							
中 信 证 券	2021030900007 659	广 和 通	2021-03- 09	488,800.00	10,000.00	14	3.50	665.31	-	-
中 信 证 券	2021031100003 144	蓝 思 科 技	2021-03- 11	449,280.00	15,600.00	14	3.40	594.05	-	-
中 信 证 券	2021031100003 146	光 环 新 网	2021-03- 11	190,000.00	10,000.00	14	3.60	266.00	-	-
中 信 证 券	2021031600000 772	蓝 思 科 技	2021-03- 16	2,624,000.0 0	100,000.0 0	14	3.50	3,571.56	-	-
中 信 证 券	2021031600006 356	长 盈 精 密	2021-03- 16	561,270.00	26,500.00	14	3.40	742.12	-	-
中 信 证 券	2021031600006 358	蓝 思 科 技	2021-03- 16	375,232.00	14,300.00	14	3.50	510.73	-	-
中 信 证 券	2021031800000 405	中 际 旭 创	2021-03- 18	6,094,400.0 0	160,000.0 0	28	3.90	18,486.35	-	-
中 信 证 券	2021031800037 616	广 和 通	2021-03- 18	479,500.00	10,000.00	14	3.60	671.30	-	-
中 信 证 券	2021031800037 618	电 连 技 术	2021-03- 18	1,768,000.0 0	50,000.00	14	3.60	2,475.20	-	-
中 信 证 券	2021031800037 620	光 环 新 网	2021-03- 18	235,145.00	13,100.00	14	3.60	329.20	-	-
中 信	2021031800037 622	光 弘	2021-03- 18	1,183,000.0 0	100,000.0 0	14	3.60	1,656.20	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021031800037 626	蓝 思 科 技	2021-03- 18	1,063,130.0 0	41,000.00	28	3.40	2,811.39	-	-
中 信 证 券	2021031800037 628	新 易 盛	2021-03- 18	478,200.00	12,000.00	28	3.20	1,190.19	-	-
中 信 证 券	2021031800037 632	光 弘 科 技	2021-03- 18	236,600.00	20,000.00	28	3.50	644.08	-	-
中 信 证 券	2021031800037 634	信 维 通 信	2021-03- 18	272,200.00	10,000.00	14	3.50	370.49	-	-
中 信 证 券	2021032300000 491	中 科 创 达	2021-03- 23	1,911,680.0 0	16,000.00	14	3.40	2,527.67	-	-
中 信 证 券	2021032300000 497	长 盈 精 密	2021-03- 23	1,233,028.0 0	56,200.00	14	3.50	1,678.29	-	-
中 信 证 券	2021032300000 509	大 富 科 技	2021-03- 23	94,000.00	10,000.00	14	4.20	153.53	-	-
中 信 证 券	2021032300007 757	广 和 通	2021-03- 23	526,000.00	10,000.00	14	4.10	838.68	-	-
中 信 证 券	2021032300007 759	蓝 思 科 技	2021-03- 23	751,200.00	30,000.00	14	3.50	1,022.47	-	-
中 信 证 券	2021032300007 761	蓝 思 科 技	2021-03- 23	270,432.00	10,800.00	28	3.40	715.14	-	-
中 信 证 券	2021032300007 763	蓝 思 科 技	2021-03- 23	751,200.00	30,000.00	14	3.50	1,022.47	-	-

券		技								
中信 证券	2021032300007 765	光 弘 科 技	2021-03- 23	119,100.00	10,000.00	14	3.70	171.37	-	-
中信 证券	2021032300007 979	蓝 思 科 技	2021-03- 23	751,200.00	30,000.00	14	3.50	1,022.47	-	-
中信 证券	2021032300007 981	硕 贝 德	2021-03- 23	3,916,500.0 0	350,000.0 0	28	4.00	12,184.67	-	-
中信 证券	2021032400006 324	信 维 通 信	2021-03- 24	243,180.00	9,000.00	28	4.20	794.39	-	-
中信 证券	2021032400006 326	天 孚 通 信	2021-03- 24	389,700.00	10,000.00	28	4.00	1,212.40	-	-
中信 证券	2021032400006 644	天 孚 通 信	2021-03- 24	389,700.00	10,000.00	28	4.00	1,212.40	-	-
中信 证券	2021032500000 544	信 维 通 信	2021-03- 25	1,325,280.0 0	48,000.00	14	3.30	1,700.78	-	-
中信 证券	2021032500000 546	长 盈 精 密	2021-03- 25	571,662.00	27,300.00	14	3.50	778.10	-	-
中信 证券	2021032500000 554	光 环 新 网	2021-03- 25	340,164.00	19,800.00	14	3.70	489.46	-	-
中信 证券	2021032500006 292	蓝 思 科 技	2021-03- 25	2,498,000.0 0	100,000.0 0	28	3.40	6,605.82	-	-
中信 证券	2021032500006 294	中 际 旭 创	2021-03- 25	6,992,000.0 0	200,000.0 0	28	3.90	21,209.07	-	-

中信证券	2021032500006300	蓝思科技	2021-03-25	3,269,882.00	130,900.00	28	3.40	8,647.02	-	-
中信证券	2021032500006302	蓝思科技	2021-03-25	389,688.00	15,600.00	28	3.40	1,030.51	-	-
中信证券	2021032500006308	光环新网	2021-03-25	171,800.00	10,000.00	14	4.20	280.61	-	-
中信证券	2021032500006310	蓝思科技	2021-03-25	389,688.00	15,600.00	14	3.50	530.41	-	-
中信证券	2021033000000647	东方国信	2021-03-30	326,550.00	35,000.00	14	3.70	469.87	-	-
中信证券	20210330000007859	蓝思科技	2021-03-30	431,760.00	16,800.00	28	3.40	1,141.77	-	-
中信证券	20210330000007861	蓝思科技	2021-03-30	2,570,000.00	100,000.00	14	3.50	3,498.06	-	-
中信证券	20210330000007863	蓝思科技	2021-03-30	257,000.00	10,000.00	28	3.40	679.62	-	-
中信证券	20210330000007865	光环新网	2021-03-30	203,760.00	12,000.00	28	3.60	570.53	-	-
中信证券	20210330000007867	蓝思科技	2021-03-30	367,510.00	14,300.00	14	3.50	500.22	-	-
中信证券	20210330000007869	光弘科技	2021-03-30	413,000.00	35,000.00	28	3.50	1,124.28	-	-
中	20210330000007	广	2021-03-	730,100.00	14,000.00	28	4.00	2,271.42	-	-

信 证 券	871	和 通	30							
中 信 证 券	2021033000007 875	新 易 盛	2021-03- 30	1,316,160.0 0	32,000.00	28	3.50	3,582.88	-	-
中 信 证 券	2021033000007 877	信 维 通 信	2021-03- 30	328,200.00	12,000.00	28	3.20	816.85	-	-
中 信 证 券	2021033000007 879	长 盈 精 密	2021-03- 30	565,245.00	26,500.00	14	3.50	769.36	-	-
中 信 证 券	2021033000007 881	信 维 通 信	2021-03- 30	765,800.00	28,000.00	28	3.20	1,905.99	-	-
中 信 证 券	2021040100000 464	光 环 新 网	2021-04- 01	171,800.00	10,000.00	14	3.70	247.20	-	-
中 信 证 券	2021040100032 945	广 和 通	2021-04- 01	539,900.00	10,000.00	14	4.10	860.84	-	-
中 信 证 券	2021040100032 953	光 弘 科 技	2021-04- 01	1,199,000.0 0	100,000.0 0	14	3.60	1,678.60	-	-
中 信 证 券	2021040600000 718	光 环 新 网	2021-04- 06	387,855.00	22,100.00	14	3.60	543.00	-	-
中 信 证 券	2021040600000 724	蓝 思 科 技	2021-04- 06	260,400.00	10,000.00	14	3.40	344.31	-	-
中 信 证 券	2021040600017 324	长 盈 精 密	2021-04- 06	1,255,508.0 0	56,200.00	14	3.50	1,708.89	-	-
中 信	2021040600017 326	大 富	2021-04- 06	95,000.00	10,000.00	14	3.70	136.69	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021040600017 334	广 和 通	2021-04- 06	544,000.00	10,000.00	14	4.50	952.00	-	-
中 信 证 券	2021040600017 336	光 弘 科 技	2021-04- 06	253,000.00	20,000.00	28	4.40	927.66	-	-
中 信 证 券	2021040600017 338	光 弘 科 技	2021-04- 06	126,500.00	10,000.00	14	4.50	221.38	-	-
中 信 证 券	2021040600017 340	蓝 思 科 技	2021-04- 06	781,200.00	30,000.00	14	3.30	1,002.54	-	-
中 信 证 券	2021040600017 342	蓝 思 科 技	2021-04- 06	781,200.00	30,000.00	14	3.30	1,002.54	-	-
中 信 证 券	2021040800000 566	天 孚 通 信	2021-04- 08	80,440.00	2,000.00	14	3.50	109.49	-	-
中 信 证 券	2021040800000 574	中 际 旭 创	2021-04- 08	971,500.00	26,800.00	28	3.30	2,493.52	-	-
中 信 证 券	2021040800000 578	长 盈 精 密	2021-04- 08	2,756,799.0 0	127,100.0 0	14	3.50	3,752.31	-	-
中 信 证 券	2021040800000 580	光 环 新 网	2021-04- 08	651,672.00	37,800.00	14	3.60	912.34	-	-
中 信 证 券	2021040800000 582	蓝 思 科 技	2021-04- 08	431,256.00	16,800.00	28	3.30	1,106.89	-	-
中 信 证 券	2021040800000 590	蓝 思 科 技	2021-04- 08	256,700.00	10,000.00	14	3.40	339.41	-	-

券		技								
中信证券	2021040800004 723	蓝思科技	2021-04-08	400,452.00	15,600.00	14	3.30	513.91	-	-
中信证券	2021040800004 725	长盈精密	2021-04-08	592,137.00	27,300.00	14	3.50	805.96	-	-
中信证券	2021040800004 727	光环新网	2021-04-08	341,352.00	19,800.00	14	3.70	491.17	-	-
中信证券	2021040800004 729	信维通信	2021-04-08	1,384,800.0 0	48,000.00	14	3.40	1,831.01	-	-
中信证券	2021040800004 731	光环新网	2021-04-08	172,400.00	10,000.00	14	3.70	248.06	-	-
中信证券	2021041300000 939	大富科技	2021-04-13	332,280.00	36,000.00	14	4.10	529.80	-	-
中信证券	2021041300000 945	光环新网	2021-04-13	168,900.00	10,000.00	14	3.70	243.03	-	-
中信证券	2021041300000 949	长盈精密	2021-04-13	3,960,000.0 0	200,000.0 0	14	3.50	5,390.00	-	-
中信证券	2021041300008 373	东方国信	2021-04-13	325,150.00	35,000.00	14	3.60	455.21	-	-
中信证券	2021041300008 375	蓝思科技	2021-04-13	362,934.00	14,300.00	14	3.40	479.88	-	-
中信证券	2021041300008 377	长盈精密	2021-04-13	524,700.00	26,500.00	14	3.50	714.18	-	-

中信证券	2021041300008379	蓝思科技	2021-04-13	2,538,000.00	100,000.00	14	3.40	3,355.80	-	-
中信证券	2021041500030468	光弘科技	2021-04-15	244,600.00	20,000.00	28	3.40	646.83	-	-
中信证券	2021041500030470	广和通	2021-04-15	571,000.00	10,000.00	14	3.50	777.19	-	-
中信证券	2021041500030472	光环新网	2021-04-15	170,300.00	10,000.00	14	3.60	238.42	-	-
中信证券	2021041500030474	中际旭创	2021-04-15	5,416,000.00	160,000.00	28	3.30	13,901.07	-	-
中信证券	2021041500030476	新易盛	2021-04-15	488,760.00	12,000.00	28	3.20	1,216.47	-	-
中信证券	2021041500030478	蓝思科技	2021-04-15	1,034,430.00	41,000.00	28	3.30	2,655.04	-	-
中信证券	2021042000001103	天孚通信	2021-04-20	397,900.00	10,000.00	14	3.70	654.32	-	-
中信证券	2021042000001117	蓝思科技	2021-04-20	2,004,912.00	75,600.00	14	3.40	3,029.65	-	-
中信证券	2021042000015634	广和通	2021-04-20	577,200.00	10,000.00	14	4.10	1,051.78	-	-
中信证券	2021042000015638	光弘科技	2021-04-20	136,200.00	10,000.00	14	3.50	211.86	-	-
中	2021042000015	长	2021-04-	1,170,646.0	56,200.00	14	3.50	1,821.01	-	-

信 证 券	650	盈 精 密	20	0						
中 信 证 券	2021042000015 652	蓝 思 科 技	2021-04- 20	795,600.00	30,000.00	14	3.40	1,202.24	-	-
中 信 证 券	2021042000015 656	蓝 思 科 技	2021-04- 20	286,416.00	10,800.00	28	3.30	735.13	-	-
中 信 证 券	2021042000015 660	大 富 科 技	2021-04- 20	95,100.00	10,000.00	14	4.10	173.29	-	-
中 信 证 券	2021042000015 662	光 环 新 网	2021-04- 20	386,971.00	22,100.00	14	3.70	636.35	-	-
中 信 证 券	2021042000015 664	硕 贝 德	2021-04- 20	3,941,000.0 0	350,000.0 0	28	4.00	12,260.89	-	-
中 信 证 券	2021042100007 493	天 孚 通 信	2021-04- 21	392,500.00	10,000.00	28	3.50	1,068.47	-	-
中 信 证 券	2021042100007 495	天 孚 通 信	2021-04- 21	392,500.00	10,000.00	28	3.50	1,068.47	-	-
中 信 证 券	2021042100007 497	信 维 通 信	2021-04- 21	258,120.00	9,000.00	28	3.20	642.43	-	-
中 信 证 券	2021042200000 682	东 方 国 信	2021-04- 22	93,900.00	10,000.00	14	3.60	131.46	-	-
中 信 证 券	2021042200000 710	光 环 新 网	2021-04- 22	206,625.00	12,500.00	14	3.60	289.28	-	-
中 信	2021042200000 718	广 和	2021-04- 22	58,380.00	1,000.00	14	3.70	84.00	-	-

证 券		通								
中 信 证 券	2021042200000 720	天 孚 通 信	2021-04- 22	82,240.00	2,000.00	14	3.70	118.33	-	-
中 信 证 券	2021042200000 722	光 弘 科 技	2021-04- 22	567,840.00	42,000.00	14	3.50	772.89	-	-
中 信 证 券	2021042200000 724	新 易 盛	2021-04- 22	429,600.00	10,000.00	14	3.40	568.03	-	-
中 信 证 券	2021042200006 938	天 孚 通 信	2021-04- 22	82,240.00	2,000.00	14	3.60	115.14	-	-
中 信 证 券	2021042200006 942	长 盈 精 密	2021-04- 22	565,656.00	27,300.00	14	3.50	769.92	-	-
中 信 证 券	2021042200006 944	信 维 通 信	2021-04- 22	1,400,160.0 0	48,000.00	14	3.30	1,796.87	-	-
中 信 证 券	2021042200006 952	蓝 思 科 技	2021-04- 22	2,791,000.0 0	100,000.0 0	28	3.30	7,163.57	-	-
中 信 证 券	2021042200006 956	蓝 思 科 技	2021-04- 22	3,653,419.0 0	130,900.0 0	28	3.30	9,377.11	-	-
中 信 证 券	2021042200006 958	中 际 旭 创	2021-04- 22	6,726,000.0 0	200,000.0 0	28	3.30	17,263.40	-	-
中 信 证 券	2021042200006 960	蓝 思 科 技	2021-04- 22	435,396.00	15,600.00	28	3.30	1,117.52	-	-
中 信 证 券	2021042200007 346	长 盈 精	2021-04- 22	2,633,512.0 0	127,100.0 0	14	3.50	3,584.50	-	-

券		密								
中信 证券	2021042700000 743	大富 科技	2021-04- 27	308,430.00	34,500.00	14	4.20	503.77	-	-
中信 证券	2021042700000 745	天孚 通信	2021-04- 27	461,100.00	10,000.00	14	3.80	681.40	-	-
中信 证券	2021042700000 763	光环 新网	2021-04- 27	4,549,248.0 0	287,200.0 0	14	3.60	6,368.95	-	-
中信 证券	2021042700000 845	蓝思 科技	2021-04- 27	976,820.00	33,800.00	14	3.40	1,291.57	-	-
中信 证券	2021042700011 828	广和 通	2021-04- 27	795,620.00	14,000.00	28	3.60	2,227.74	-	-
中信 证券	2021042700011 830	光弘 科技	2021-04- 27	399,000.00	35,000.00	28	3.40	1,055.13	-	-
中信 证券	2021042700011 838	新易 盛	2021-04- 27	1,276,800.0 0	32,000.00	28	3.30	3,277.12	-	-
中信 证券	2021042700011 840	长盈 精密	2021-04- 27	536,625.00	26,500.00	14	3.50	730.41	-	-
中信 证券	2021042700011 842	大富 科技	2021-04- 27	321,840.00	36,000.00	14	4.20	525.67	-	-
中信 证券	2021042700011 844	信维 通信	2021-04- 27	787,640.00	28,000.00	28	3.30	2,021.61	-	-
中信 证券	2021042700011 848	长盈 精密	2021-04- 27	4,050,000.0 0	200,000.0 0	14	3.50	5,512.50	-	-

中信证券	2021042700011850	蓝思科技	2021-04-27	2,890,000.00	100,000.00	14	3.40	3,821.22	-	-
中信证券	2021042700011852	蓝思科技	2021-04-27	289,000.00	10,000.00	28	3.30	741.77	-	-
中信证券	2021042700011854	蓝思科技	2021-04-27	485,520.00	16,800.00	28	3.30	1,246.17	-	-
中信证券	2021042700011856	信维通信	2021-04-27	337,560.00	12,000.00	28	3.30	866.40	-	-
中信证券	2021042700011858	光环新网	2021-04-27	190,080.00	12,000.00	28	3.50	517.44	-	-
中信证券	2021042700011860	蓝思科技	2021-04-27	413,270.00	14,300.00	14	3.40	546.43	-	-
中信证券	2021042900000603	长盈精密	2021-04-29	315,680.00	16,000.00	14	3.50	429.68	-	-
中信证券	2021042900000607	光环新网	2021-04-29	1,983,530.00	139,000.00	14	3.60	2,776.94	-	-
中信证券	2021042900000609	蓝思科技	2021-04-29	267,400.00	10,000.00	14	3.40	353.56	-	-
中信证券	2021042900000615	蓝思科技	2021-04-29	989,380.00	37,000.00	14	3.40	1,308.18	-	-
中信证券	20210429000024637	广和通	2021-04-29	575,000.00	10,000.00	14	3.70	827.36	-	-
中	20210429000024	光	2021-04-	142,700.00	10,000.00	14	3.60	199.78	-	-

信 证 券	639	环 新 网	29							
中 信 证 券	2021050600000 823	圣 邦 股 份	2021-05- 06	10,806,016. 00	41,600.00	14	3.60	15,128.42	-	-
中 信 证 券	2021050600000 929	蓝 思 科 技	2021-05- 06	258,100.00	10,000.00	14	3.40	341.27	-	-
中 信 证 券	2021050600000 949	大 富 科 技	2021-05- 06	560,205.00	63,300.00	14	4.20	915.00	-	-
中 信 证 券	2021050600026 452	信 维 通 信	2021-05- 06	1,302,240.0 0	48,000.00	14	3.00	1,519.28	-	-
中 信 证 券	2021050600026 928	中 际 旭 创	2021-05- 06	923,528.00	26,800.00	28	3.60	2,585.88	-	-
中 信 证 券	2021050600026 934	大 富 科 技	2021-05- 06	88,500.00	10,000.00	14	4.20	144.55	-	-
中 信 证 券	2021050600026 936	长 盈 精 密	2021-05- 06	1,074,544.0 0	56,200.00	14	3.50	1,462.57	-	-
中 信 证 券	2021050600026 940	光 环 新 网	2021-05- 06	312,936.00	22,100.00	14	3.60	438.11	-	-
中 信 证 券	2021050600026 950	广 和 通	2021-05- 06	583,600.00	10,000.00	14	3.70	839.74	-	-
中 信 证 券	2021050600026 952	光 弘 科 技	2021-05- 06	106,900.00	10,000.00	14	3.50	145.50	-	-
中 信	2021050600026 954	天 孚	2021-05- 06	430,100.00	10,000.00	14	3.70	618.87	-	-

证 券		通 信								
中 信 证 券	2021050600026 956	蓝 思 科 技	2021-05- 06	774,300.00	30,000.00	14	3.40	1,023.80	-	-
中 信 证 券	2021050600026 958	蓝 思 科 技	2021-05- 06	433,608.00	16,800.00	28	3.30	1,112.93	-	-
中 信 证 券	2021050600026 960	光 弘 科 技	2021-05- 06	213,800.00	20,000.00	28	3.40	565.38	-	-
中 信 证 券	2021050600026 962	蓝 思 科 技	2021-05- 06	1,951,236.0 0	75,600.00	14	3.40	2,579.97	-	-
中 信 证 券	2021050600028 294	光 环 新 网	2021-05- 06	177,000.00	12,500.00	14	3.60	247.80	-	-
中 信 证 券	2021050600028 296	长 盈 精 密	2021-05- 06	2,430,152.0 0	127,100.0 0	14	3.50	3,307.71	-	-
中 信 证 券	2021050600028 298	长 盈 精 密	2021-05- 06	521,976.00	27,300.00	14	3.50	710.47	-	-
中 信 证 券	2021050600028 300	光 弘 科 技	2021-05- 06	448,980.00	42,000.00	14	3.50	611.11	-	-
中 信 证 券	2021050600029 230	广 和 通	2021-05- 06	58,360.00	1,000.00	14	3.50	79.43	-	-
中 信 证 券	2021050600029 232	天 孚 通 信	2021-05- 06	86,020.00	2,000.00	14	3.80	127.12	-	-
中 信 证 券	2021050600029 234	天 孚 通	2021-05- 06	86,020.00	2,000.00	14	3.80	127.12	-	-

券		信								
中信 证券	2021050600029 238	东方 国信	2021-05- 06	87,400.00	10,000.00	14	4.10	139.35	-	-
中信 证券	2021050600029 368	新易 盛	2021-05- 06	386,800.00	10,000.00	14	3.50	526.48	-	-
中信 证券	2021051100000 888	蓝思 科技	2021-05- 11	4,344,095.0 0	171,500.0 0	14	3.50	5,912.80	-	-
中信 证券	2021051100000 890	光环 新网	2021-05- 11	583,946.00	41,800.00	14	3.50	794.82	-	-
中信 证券	2021051100000 894	新易 盛	2021-05- 11	362,800.00	10,000.00	14	3.50	493.81	-	-
中信 证券	2021051100000 896	大富 科技	2021-05- 11	247,084.00	27,700.00	14	3.90	374.74	-	-
中信 证券	2021051100000 900	中际 旭创	2021-05- 11	833,112.00	25,200.00	14	3.30	1,069.16	-	-
中信 证券	2021051100010 749	大富 科技	2021-05- 11	321,120.00	36,000.00	14	4.20	524.50	-	-
中信 证券	2021051100010 751	长盈 精密	2021-05- 11	3,688,000.0 0	200,000.0 0	14	3.50	5,019.78	-	-
中信 证券	2021051100010 753	长盈 精密	2021-05- 11	488,660.00	26,500.00	14	3.50	665.12	-	-
中信 证券	2021051100010 757	蓝思 科技	2021-05- 11	2,533,000.0 0	100,000.0 0	14	3.40	3,349.19	-	-

中信证券	2021051100010763	大富科技	2021-05-11	307,740.00	34,500.00	14	4.20	502.64	-	-
中信证券	2021051100010765	蓝思科技	2021-05-11	856,154.00	33,800.00	14	3.40	1,132.03	-	-
中信证券	2021051100010767	蓝思科技	2021-05-11	362,219.00	14,300.00	14	3.40	478.93	-	-
中信证券	2021051100010769	天孚通信	2021-05-11	399,500.00	10,000.00	14	3.80	590.37	-	-
中信证券	2021051300000676	光弘科技	2021-05-13	161,280.00	16,000.00	14	3.30	206.98	-	-
中信证券	2021051300000690	大富科技	2021-05-13	512,796.00	56,600.00	14	3.90	777.74	-	-
中信证券	2021051300025298	长盈精密	2021-05-13	290,560.00	16,000.00	14	3.50	395.48	-	-
中信证券	2021051300025308	中际旭创	2021-05-13	5,513,600.00	160,000.00	28	3.50	15,009.24	-	-
中信证券	2021051300025310	蓝思科技	2021-05-13	1,025,820.00	41,000.00	28	3.30	2,632.94	-	-
中信证券	2021051300025312	蓝思科技	2021-05-13	925,740.00	37,000.00	14	3.40	1,224.03	-	-
中信证券	2021051300025314	蓝思科技	2021-05-13	250,200.00	10,000.00	14	3.40	330.82	-	-
中	2021051300025	广	2021-05-	540,000.00	10,000.00	14	3.50	735.00	-	-

信 证 券	316	和 通	13							
中 信 证 券	2021051300026 402	光 环 新 网	2021-05- 13	142,600.00	10,000.00	14	3.60	199.64	-	-
中 信 证 券	2021051300026 404	光 环 新 网	2021-05- 13	1,982,140.0 0	139,000.0 0	14	3.60	2,775.00	-	-
中 信 证 券	2021051300026 406	新 易 盛	2021-05- 13	462,120.00	12,000.00	28	3.40	1,222.05	-	-
中 信 证 券	2021051300026 408	光 弘 科 技	2021-05- 13	201,600.00	20,000.00	28	3.40	533.12	-	-
中 信 证 券	2021051700004 081	硕 贝 德	2021-04- 20	7,000.00	-	28	4.00	-	-	-
中 信 证 券	2021051800000 510	大 富 科 技	2021-05- 18	1,495,200.0 0	168,000.0 0	14	3.80	2,209.57	-	-
中 信 证 券	2021051800000 512	中 际 旭 创	2021-05- 18	7,120,000.0 0	200,000.0 0	14	3.20	8,860.44	-	-
中 信 证 券	2021051800000 514	东 方 国 信	2021-05- 18	1,494,710.0 0	163,000.0 0	14	3.50	2,034.47	-	-
中 信 证 券	2021051800000 516	中 科 创 达	2021-05- 18	1,469,900.0 0	10,000.00	14	3.40	1,943.53	-	-
中 信 证 券	2021051800000 518	蓝 思 科 技	2021-05- 18	261,600.00	10,000.00	14	3.50	356.07	-	-
中 信	2021051800000 522	光 环	2021-05- 18	433,500.00	30,000.00	14	3.50	590.04	-	-

证 券		新 网								
中 信 证 券	2021052000000 507	东 方 国 信	2021-05- 20	982,345.00	110,500.0 0	14	3.50	1,337.08	-	-
中 信 证 券	2021052000000 519	中 科 创 达	2021-05- 20	1,481,200.0 0	10,000.00	14	3.40	1,958.48	-	-
中 信 证 券	2021052000000 521	蓝 思 科 技	2021-05- 20	1,389,274.0 0	49,300.00	14	3.50	1,890.96	-	-
中 信 证 券	2021052000000 525	新 易 盛	2021-05- 20	1,538,830.0 0	37,000.00	14	3.50	2,094.52	-	-
中 信 证 券	2021052000000 529	光 弘 科 技	2021-05- 20	127,320.00	12,000.00	14	3.40	168.35	-	-
中 信 证 券	2021052000018 371	光 环 新 网	2021-05- 20	182,250.00	12,500.00	14	3.50	248.06	-	-
中 信 证 券	2021052000018 373	新 易 盛	2021-05- 20	415,900.00	10,000.00	14	3.50	566.09	-	-
中 信 证 券	2021052000018 375	光 环 新 网	2021-05- 20	322,218.00	22,100.00	14	3.50	438.57	-	-
中 信 证 券	2021052000018 377	东 方 国 信	2021-05- 20	88,900.00	10,000.00	14	3.20	110.63	-	-
中 信 证 券	2021052000018 379	信 维 通 信	2021-05- 20	1,286,400.0 0	48,000.00	14	3.30	1,650.88	-	-
中 信 证 券	2021052000018 381	长 盈 精	2021-05- 20	523,887.00	27,300.00	14	3.50	713.07	-	-

券		密								
中信 证券	2021052000018 385	蓝 思 科 技	2021-05- 20	845,400.00	30,000.00	14	3.50	1,150.68	-	-
中信 证券	2021052000018 387	圣 邦 股 份	2021-05- 20	10,657,920. 00	41,600.00	14	3.70	15,335.56	-	-
中信 证券	2021052000018 389	长 盈 精 密	2021-05- 20	2,439,049.0 0	127,100.0 0	14	3.50	3,319.82	-	-
中信 证券	2021052000018 391	光 弘 科 技	2021-05- 20	445,620.00	42,000.00	14	3.30	571.88	-	-
中信 证券	2021052000018 393	大 富 科 技	2021-05- 20	563,370.00	63,300.00	14	3.90	854.44	-	-
中信 证券	2021052000018 395	长 盈 精 密	2021-05- 20	1,078,478.0 0	56,200.00	14	3.50	1,467.93	-	-
中信 证券	2021052000018 397	大 富 科 技	2021-05- 20	89,000.00	10,000.00	14	3.90	134.98	-	-
中信 证券	2021052000018 399	天 孚 通 信	2021-05- 20	440,300.00	10,000.00	14	4.00	684.91	-	-
中信 证券	2021052000018 401	光 弘 科 技	2021-05- 20	106,100.00	10,000.00	14	3.30	136.16	-	-
中信 证券	2021052000018 403	广 和 通	2021-05- 20	58,690.00	1,000.00	14	3.60	82.17	-	-
中信 证券	2021052000018 405	天 孚 通 信	2021-05- 20	88,060.00	2,000.00	14	4.00	136.98	-	-

中信 证 券	2021052000018 407	天 孚 通 信	2021-05- 20	88,060.00	2,000.00	14	4.00	136.98	-	-
中信 证 券	2021052000018 409	蓝 思 科 技	2021-05- 20	281,800.00	10,000.00	14	3.50	383.56	-	-
中信 证 券	2021052000018 437	蓝 思 科 技	2021-05- 20	2,130,408.0 0	75,600.00	14	3.50	2,899.72	-	-
中信 证 券	2021052400006 984	光 环 新 网	2021-04- 27	300.00	-	28	3.50	-	-	-
中信 证 券	2021052400007 010	光 环 新 网	2021-05- 20	312.50	-	14	3.50	-	-	-
中信 证 券	2021052400007 012	光 环 新 网	2021-05- 20	552.50	-	14	3.50	-	-	-
中信 证 券	2021052400007 021	光 环 新 网	2021-05- 18	750.00	-	14	3.50	-	-	-
中信 证 券	2021052400007 038	光 环 新 网	2021-05- 13	250.00	-	14	3.60	-	-	-
中信 证 券	2021052400007 040	光 环 新 网	2021-05- 13	3,475.00	-	14	3.60	-	-	-
中信 证 券	2021052400007 063	光 环 新 网	2021-05- 11	1,045.00	-	14	3.50	-	-	-
中信 证 券	2021052400007 074	广 和 通	2021-04- 27	4,200.00	-	28	3.60	-	-	-
中	2021052400007	广	2021-05-	3,000.00	-	14	3.50	-	-	-

信 证 券	080	和 通	13							
中 信 证 券	2021052400007 088	广 和 通	2021-05- 20	300.00	-	14	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021052400007 090	广 和 通	2021-04- 27	-	9,800.00	28	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021052400007 096	广 和 通	2021-05- 13	-	7,000.00	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	2021052400007 104	广 和 通	2021-05- 20	-	700.00	14	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021052400007 106	光 弘 科 技	2021-04- 27	7,000.00	-	28	3.40	-	-	-
中 信 证 券	2021052400007 110	光 弘 科 技	2021-05- 06	4,000.00	-	28	3.40	-	-	-
中 信 证 券	2021052400007 127	光 弘 科 技	2021-05- 13	3,200.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	2021052400007 136	光 弘 科 技	2021-05- 13	4,000.00	-	28	3.40	-	-	-
中 信 证 券	2021052400007 143	光 弘 科 技	2021-05- 20	2,400.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	2021052400007 150	光 弘 科 技	2021-05- 20	8,400.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信	2021052400007 152	光 弘	2021-05- 20	2,000.00	-	14	3.30	-	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021052500000 955	新 易 盛	2021-05- 25	2,064,969.0 0	47,900.00	14	3.60	2,890.96	-	-
中 信 证 券	2021052500000 963	东 方 国 信	2021-05- 25	1,493,100.0 0	158,000.0 0	14	3.50	2,032.28	-	-
中 信 证 券	2021052500000 967	蓝 思 科 技	2021-05- 25	4,102,014.0 0	141,400.0 0	14	3.50	5,583.30	-	-
中 信 证 券	2021052500008 680	新 易 盛	2021-05- 25	431,100.00	10,000.00	14	3.50	586.78	-	-
中 信 证 券	2021052500008 682	光 环 新 网	2021-05- 25	613,206.00	41,800.00	14	3.50	834.64	-	-
中 信 证 券	2021052500008 684	中 际 旭 创	2021-05- 25	959,112.00	25,200.00	14	3.20	1,193.56	-	-
中 信 证 券	2021052500008 688	蓝 思 科 技	2021-05- 25	980,538.00	33,800.00	14	3.50	1,334.62	-	-
中 信 证 券	2021052500008 690	蓝 思 科 技	2021-05- 25	2,901,000.0 0	100,000.0 0	14	3.50	3,948.58	-	-
中 信 证 券	2021052500008 692	蓝 思 科 技	2021-05- 25	414,843.00	14,300.00	14	3.50	564.65	-	-
中 信 证 券	2021052500008 694	蓝 思 科 技	2021-05- 25	4,975,215.0 0	171,500.0 0	14	3.50	6,771.82	-	-
中 信 证 券	2021052500008 696	长 盈 精	2021-05- 25	510,655.00	26,500.00	14	3.50	695.06	-	-

券		密								
中信 证券	2021052500008 698	天孚 通信	2021-05- 25	450,600.00	10,000.00	14	3.80	665.89	-	-
中信 证券	2021052500010 266	长盈 精密	2021-05- 25	3,854,000.0 0	200,000.0 0	14	3.50	5,245.72	-	-
中信 证券	2021052500010 268	大富 科技	2021-05- 25	325,800.00	36,000.00	14	3.80	481.46	-	-
中信 证券	2021052500010 270	大富 科技	2021-05- 25	312,225.00	34,500.00	14	3.80	461.40	-	-
中信 证券	2021052500010 272	大富 科技	2021-05- 25	250,685.00	27,700.00	14	3.80	370.46	-	-
中信 证券	2021052700000 828	电连 技术	2021-05- 27	2,072,360.0 0	50,300.00	14	3.60	2,901.30	-	-
中信 证券	2021052700000 836	光弘 科技	2021-05- 27	104,200.00	10,000.00	14	3.50	141.83	-	-
中信 证券	2021052700000 843	大富 科技	2021-05- 27	3,097,030.0 0	337,000.0 0	14	3.90	4,697.16	-	-
中信 证券	2021052700000 846	广和 通	2021-05- 27	382,900.00	10,000.00	14	3.90	580.73	-	-
中信 证券	2021052700000 852	蓝思 科技	2021-05- 27	4,402,836.0 0	152,400.0 0	14	3.50	5,992.75	-	-
中信 证券	2021052700000 854	长盈 精密	2021-05- 27	1,576,500.0 0	75,000.00	14	3.50	2,145.79	-	-

中信证券	2021052700018735	广和通	2021-05-27	382,900.00	10,000.00	14	3.80	565.84	-	-
中信证券	2021052700018737	蓝思科技	2021-05-27	288,900.00	10,000.00	14	3.50	393.23	-	-
中信证券	2021052700018739	蓝思科技	2021-05-27	1,068,930.00	37,000.00	14	3.50	1,454.93	-	-
中信证券	2021052700018741	光弘科技	2021-05-27	166,720.00	16,000.00	14	3.40	220.44	-	-
中信证券	2021052700018747	光环新网	2021-05-27	2,104,460.00	139,000.00	14	3.50	2,864.40	-	-
中信证券	2021052700018751	大富科技	2021-05-27	520,154.00	56,600.00	14	3.80	768.67	-	-
中信证券	2021052700018753	长盈精密	2021-05-27	336,320.00	16,000.00	14	3.50	457.77	-	-
中信证券	2021052700018755	光环新网	2021-05-27	151,400.00	10,000.00	14	3.50	206.07	-	-
中信证券	2021060100000662	蓝思科技	2021-06-01	7,252,500.00	250,000.00	14	3.40	9,589.42	-	-
中信证券	2021060100000674	长盈精密	2021-06-01	1,523,660.00	71,000.00	14	3.50	2,073.87	-	-
中信证券	2021060100002537	大富科技	2021-06-01	1,560,720.00	168,000.00	14	3.90	2,367.09	-	-
中	2021060100002	蓝	2021-06-	290,100.00	10,000.00	14	3.50	394.86	-	-

信 证 券	541	思 科 技	01							
中 信 证 券	2021060100002 543	光 环 新 网	2021-06- 01	461,400.00	30,000.00	14	3.60	645.96	-	-
中 信 证 券	2021060100002 545	东 方 国 信	2021-06- 01	1,574,580.0 0	163,000.0 0	14	3.50	2,143.18	-	-
中 信 证 券	2021060300000 805	东 方 国 信	2021-06- 03	947,000.00	100,000.0 0	14	3.60	1,325.80	-	-
中 信 证 券	2021060300009 728	蓝 思 科 技	2021-06- 03	486,528.00	16,800.00	28	3.30	1,248.76	-	-
中 信 证 券	2021060300009 838	长 盈 精 密	2021-06- 03	577,395.00	27,300.00	14	3.50	785.90	-	-
中 信 证 券	2021060300009 844	蓝 思 科 技	2021-06- 03	289,600.00	10,000.00	14	3.50	394.18	-	-
中 信 证 券	2021060300009 846	蓝 思 科 技	2021-06- 03	1,427,728.0 0	49,300.00	14	3.50	1,943.30	-	-
中 信 证 券	2021060300009 850	蓝 思 科 技	2021-06- 03	2,189,376.0 0	75,600.00	14	3.50	2,979.98	-	-
中 信 证 券	2021060300009 852	蓝 思 科 技	2021-06- 03	868,800.00	30,000.00	14	3.50	1,182.53	-	-
中 信 证 券	2021060300009 854	新 易 盛	2021-06- 03	1,753,800.0 0	37,000.00	14	3.60	2,455.32	-	-
中 信	2021060300009 856	新 易	2021-06- 03	474,000.00	10,000.00	14	3.60	663.60	-	-

证 券		盛								
中 信 证 券	2021060300009 866	光 弘 科 技	2021-06- 03	122,760.00	12,000.00	14	3.50	167.09	-	-
中 信 证 券	2021060300009 868	光 弘 科 技	2021-06- 03	102,300.00	10,000.00	14	3.50	139.24	-	-
中 信 证 券	2021060300009 870	大 富 科 技	2021-06- 03	93,200.00	10,000.00	14	3.90	141.35	-	-
中 信 证 券	2021060300009 872	天 孚 通 信	2021-06- 03	94,180.00	2,000.00	14	3.60	131.85	-	-
中 信 证 券	2021060300009 874	广 和 通	2021-06- 03	38,160.00	1,000.00	14	3.90	57.88	-	-
中 信 证 券	2021060300009 876	天 孚 通 信	2021-06- 03	470,900.00	10,000.00	14	3.60	659.26	-	-
中 信 证 券	2021060300010 610	光 弘 科 技	2021-06- 03	429,660.00	42,000.00	14	3.50	584.82	-	-
中 信 证 券	2021060300010 614	大 富 科 技	2021-06- 03	589,956.00	63,300.00	14	3.90	894.77	-	-
中 信 证 券	2021060300010 618	长 盈 精 密	2021-06- 03	1,188,630.0 0	56,200.00	14	3.50	1,617.86	-	-
中 信 证 券	2021060300010 620	长 盈 精 密	2021-06- 03	2,688,165.0 0	127,100.0 0	14	3.50	3,658.89	-	-
中 信 证 券	2021060300010 624	天 孚 通	2021-06- 03	94,180.00	2,000.00	14	3.60	131.85	-	-

券		信								
中信 证券	2021060300010 628	信 维 通 信	2021-06- 03	1,380,000.0 0	48,000.00	14	3.10	1,663.67	-	-
中信 证券	2021060300010 630	光 环 新 网	2021-06- 03	186,500.00	12,500.00	14	3.60	261.10	-	-
中信 证券	2021060300010 632	光 环 新 网	2021-06- 03	329,732.00	22,100.00	14	3.60	461.62	-	-
中信 证券	2021060300010 634	东 方 国 信	2021-06- 03	1,046,435.0 0	110,500.0 0	14	3.50	1,424.31	-	-
中信 证券	2021060300010 638	圣 邦 股 份	2021-06- 03	11,147,552. 00	41,600.00	14	3.70	16,040.09	-	-
中信 证券	2021060300011 508	长 盈 精 密	2021-06- 03	5,620.00	-	14	3.50	-	-	-
中信 证券	2021060300011 510	长 盈 精 密	2021-06- 03	12,710.00	-	14	3.50	-	-	-
中信 证券	2021060300011 512	长 盈 精 密	2021-06- 03	2,730.00	-	14	3.50	-	-	-
中信 证券	2021060300011 539	长 盈 精 密	2021-06- 01	7,100.00	-	14	3.50	-	-	-
中信 证券	2021060300011 572	长 盈 精 密	2021-05- 27	1,600.00	-	14	3.50	-	-	-
中信 证券	2021060300011 591	长 盈 精 密	2021-05- 27	7,500.00	-	14	3.50	-	-	-

中信证券	2021060300011618	长盈精密	2021-05-25	20,000.00	-	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060300011636	长盈精密	2021-05-25	2,650.00	-	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060300011676	长盈精密	2021-06-03	-	11,240.00	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060300011678	长盈精密	2021-06-03	-	25,420.00	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060300011680	长盈精密	2021-06-03	-	5,460.00	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060300011707	长盈精密	2021-06-01	-	14,200.00	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060300011740	长盈精密	2021-05-27	-	3,200.00	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060300011759	长盈精密	2021-05-27	-	15,000.00	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060300011786	长盈精密	2021-05-25	-	40,000.00	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060300011804	长盈精密	2021-05-25	-	5,300.00	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021060700005701	新易盛	2021-05-13	3,260.50	-	28	3.40	-	-	-
中	2021060700005	新	2021-05-	13,014.82	-	14	3.60	-	-	-

信 证 券	702	易 盛	25							
中 信 证 券	2021060700005 705	新 易 盛	2021-05- 25	2,717.08	-	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	2021060700005 727	新 易 盛	2021-06- 03	10,053.20	-	14	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021060700005 729	新 易 盛	2021-06- 03	2,717.08	-	14	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021060700005 747	新 易 盛	2021-05- 13	-	4,803.00	28	3.40	-	-	-
中 信 证 券	2021060700005 748	新 易 盛	2021-05- 25	-	19,172.00	14	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021060700005 751	新 易 盛	2021-05- 25	-	4,003.00	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	2021060700005 773	新 易 盛	2021-06- 03	-	14,809.00	14	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021060700005 775	新 易 盛	2021-06- 03	-	4,003.00	14	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021060800005 845	大 富 科 技	2021-06- 08	361,440.00	36,000.00	14	4.00	562.24	-	-
中 信 证 券	2021060800005 847	天 孚 通 信	2021-06- 08	488,500.00	10,000.00	14	3.50	664.90	-	-
中 信	2021060800005 849	大 富	2021-06- 08	346,380.00	34,500.00	14	4.00	538.81	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021060800005 851	大 富 科 技	2021-06- 08	278,108.00	27,700.00	14	4.00	432.61	-	-
中 信 证 券	2021060800005 857	新 易 盛	2021-06- 08	1,583,095.0 0	47,900.00	14	3.50	2,154.77	-	-
中 信 证 券	2021060800005 859	东 方 国 信	2021-06- 08	1,635,300.0 0	158,000.0 0	14	3.60	2,289.42	-	-
中 信 证 券	2021060800005 861	光 环 新 网	2021-06- 08	639,958.00	41,800.00	14	3.50	871.05	-	-
中 信 证 券	2021060800005 863	新 易 盛	2021-06- 08	330,500.00	10,000.00	14	3.50	449.85	-	-
中 信 证 券	2021060800005 865	中 际 旭 创	2021-06- 08	1,002,960.0 0	25,200.00	14	3.20	1,248.13	-	-
中 信 证 券	2021060800005 867	长 盈 精 密	2021-06- 08	467,990.00	26,500.00	14	3.50	636.99	-	-
中 信 证 券	2021060800005 869	长 盈 精 密	2021-06- 08	3,532,000.0 0	200,000.0 0	14	3.50	4,807.44	-	-
中 信 证 券	2021060800005 875	蓝 思 科 技	2021-06- 08	401,830.00	14,300.00	14	3.40	531.31	-	-
中 信 证 券	2021060800005 877	蓝 思 科 技	2021-06- 08	2,810,000.0 0	100,000.0 0	14	3.40	3,715.44	-	-
中 信 证 券	2021060800005 879	蓝 思 科 技	2021-06- 08	4,819,150.0 0	171,500.0 0	14	3.40	6,371.99	-	-

券		技								
中信 证券	2021060800005 881	蓝 思 科 技	2021-06- 08	949,780.00	33,800.00	14	3.40	1,255.82	-	-
中信 证券	2021060800005 883	蓝 思 科 技	2021-06- 08	3,973,340.0 0	141,400.0 0	14	3.40	5,253.64	-	-
中信 证券	2021060800006 581	信 维 通 信	2021-06- 03	4,800.00	-	14	3.10	-	-	-
中信 证券	2021060800006 675	中 际 旭 创	2021-05- 13	19,360.00	-	28	3.50	-	-	-
中信 证券	2021060800006 723	中 际 旭 创	2021-06- 08	3,049.20	-	14	3.20	-	-	-
中信 证券	2021061000000 504	中 际 旭 创	2021-06- 10	3,980,000.0 0	100,000.0 0	14	2.70	4,179.00	-	-
中信 证券	2021061000000 505	光 弘 科 技	2021-06- 10	113,100.00	10,000.00	14	3.60	158.34	-	-
中信 证券	2021061000007 084	电 连 技 术	2021-06- 10	2,041,174.0 0	50,300.00	14	3.60	2,857.64	-	-
中信 证券	2021061000007 086	光 弘 科 技	2021-06- 10	113,100.00	10,000.00	14	3.60	158.34	-	-
中信 证券	2021061000007 088	光 弘 科 技	2021-06- 10	180,960.00	16,000.00	14	3.60	253.34	-	-
中信 证券	2021061000007 090	中 际 旭 创	2021-06- 10	6,368,000.0 0	160,000.0 0	28	3.10	15,353.96	-	-

中信证券	2021061000007092	蓝思科技	2021-06-10	1,109,460.00	41,000.00	28	3.30	2,847.61	-	-
中信证券	2021061000007094	广和通	2021-06-10	401,000.00	10,000.00	14	4.00	623.78	-	-
中信证券	2021061000007096	长盈精密	2021-06-10	1,360,500.00	75,000.00	14	3.50	1,851.79	-	-
中信证券	2021061000007098	长盈精密	2021-06-10	290,240.00	16,000.00	14	3.50	395.05	-	-
中信证券	2021061000007100	大富科技	2021-06-10	569,962.00	56,600.00	14	4.00	886.61	-	-
中信证券	2021061000007102	蓝思科技	2021-06-10	1,001,220.00	37,000.00	14	3.40	1,323.84	-	-
中信证券	2021061000007104	蓝思科技	2021-06-10	4,123,944.00	152,400.00	14	3.40	5,452.77	-	-
中信证券	2021061000007106	广和通	2021-06-10	401,000.00	10,000.00	14	4.00	623.78	-	-
中信证券	2021061000007108	蓝思科技	2021-06-10	270,600.00	10,000.00	14	3.40	357.79	-	-
中信证券	2021061000007110	大富科技	2021-06-10	3,393,590.00	337,000.00	14	4.00	5,278.92	-	-
中信证券	2021061000007112	光环新网	2021-06-10	2,190,640.00	139,000.00	14	3.50	2,981.70	-	-
中	2021061000008	光	2021-06-	157,600.00	10,000.00	14	3.50	214.51	-	-

信 证 券	592	环 新 网	10							
中 信 证 券	2021061000009 602	电 连 技 术	2021-06- 10	20,120.00	-	14	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021061000009 614	电 连 技 术	2021-06- 10	-	25,150.00	14	3.60	-	-	-
中 信 证 券	2021061500001 746	网 宿 科 技	2021-06- 15	3,130,000.0 0	500,000.0 0	14	3.50	4,260.28	-	-
中 信 证 券	2021061500001 754	光 环 新 网	2021-06- 15	1,472,940.0 0	98,000.00	14	3.40	1,947.55	-	-
中 信 证 券	2021061500001 758	中 科 创 达	2021-06- 15	1,389,100.0 0	10,000.00	14	3.40	1,836.70	-	-
中 信 证 券	2021061500001 760	新 易 盛	2021-06- 15	1,479,820.0 0	46,000.00	14	3.00	1,726.46	-	-
中 信 证 券	2021061500016 000	光 环 新 网	2021-06- 15	450,900.00	30,000.00	14	3.10	543.59	-	-
中 信 证 券	2021061500016 006	长 盈 精 密	2021-06- 15	1,255,990.0 0	71,000.00	14	3.50	1,709.54	-	-
中 信 证 券	2021061500016 008	蓝 思 科 技	2021-06- 15	280,000.00	10,000.00	14	3.50	381.11	-	-
中 信 证 券	2021061500016 010	蓝 思 科 技	2021-06- 15	7,000,000.0 0	250,000.0 0	14	3.50	9,527.78	-	-
中 信	2021061500016 014	东 方	2021-06- 15	1,791,370.0 0	163,000.0 0	14	4.10	2,856.24	-	-

证 券		国 信								
中 信 证 券	2021061500016 016	大 富 科 技	2021-06- 15	1,962,240.0 0	168,000.0 0	14	3.60	2,747.14	-	-
中 信 证 券	2021061700017 909	光 环 新 网	2021-06- 17	192,000.00	12,500.00	14	3.10	231.47	-	-
中 信 证 券	2021061700017 911	大 富 科 技	2021-06- 17	805,809.00	63,300.00	14	3.60	1,128.13	-	-
中 信 证 券	2021061700017 913	天 孚 通 信	2021-06- 17	97,800.00	2,000.00	14	3.40	129.31	-	-
中 信 证 券	2021061700017 915	广 和 通	2021-06- 17	40,140.00	1,000.00	14	3.30	51.51	-	-
中 信 证 券	2021061700017 917	蓝 思 科 技	2021-06- 17	1,326,663.0 0	49,300.00	14	3.50	1,805.74	-	-
中 信 证 券	2021061700017 921	蓝 思 科 技	2021-06- 17	2,034,396.0 0	75,600.00	14	3.50	2,769.04	-	-
中 信 证 券	2021061700017 925	蓝 思 科 技	2021-06- 17	807,300.00	30,000.00	14	3.50	1,098.83	-	-
中 信 证 券	2021061700017 929	新 易 盛	2021-06- 17	1,228,400.0 0	37,000.00	14	3.20	1,528.68	-	-
中 信 证 券	2021061700017 931	长 盈 精 密	2021-06- 17	973,946.00	56,200.00	14	3.50	1,325.65	-	-
中 信 证 券	2021061700017 933	东 方 国	2021-06- 17	1,069,000.0 0	100,000.0 0	14	4.10	1,704.46	-	-

券		信								
中信 证券	2021061700017 935	东方 国信	2021-06- 17	1,181,245.0 0	110,500.0 0	14	4.10	1,883.43	-	-
中信 证券	2021061700017 937	大富 科技	2021-06- 17	127,300.00	10,000.00	14	3.60	178.22	-	-
中信 证券	2021061700017 939	天孚 通信	2021-06- 17	489,000.00	10,000.00	14	3.40	646.57	-	-
中信 证券	2021061700017 941	光弘 科技	2021-06- 17	147,360.00	12,000.00	14	3.60	206.30	-	-
中信 证券	2021061700017 943	信维 通信	2021-06- 17	1,340,640.0 0	48,000.00	14	3.40	1,772.62	-	-
中信 证券	2021061700017 945	圣邦 股份	2021-06- 17	12,772,448. 00	41,600.00	14	3.50	17,384.72	-	-
中信 证券	2021061700017 947	天孚 通信	2021-06- 17	97,800.00	2,000.00	14	3.40	129.31	-	-
中信 证券	2021061700017 949	光弘 科技	2021-06- 17	515,760.00	42,000.00	14	3.60	722.06	-	-
中信 证券	2021061700019 741	圣邦 股份	2021-06- 17	20,800.00	-	14	3.50	-	-	-
中信 证券	2021061700019 783	圣邦 股份	2021-06- 17	-	20,800.00	14	3.50	-	-	-
中信 证券	2021062200001 472	中际 旭创	2021-06- 22	1,427,660.0 0	38,000.00	14	3.50	1,943.20	-	-

中信证券	2021062200001474	天孚通信	2021-06-22	96,600.00	2,000.00	14	3.80	142.75	-	-
中信证券	2021062200001476	长盈精密	2021-06-22	1,577,000.00	83,000.00	14	3.50	2,146.47	-	-
中信证券	2021062200011682	大富科技	2021-06-22	331,846.00	27,700.00	14	3.50	451.68	-	-
中信证券	2021062200011684	中际旭创	2021-06-22	946,764.00	25,200.00	14	2.90	1,067.74	-	-
中信证券	2021062200011686	大富科技	2021-06-22	413,310.00	34,500.00	14	3.50	562.56	-	-
中信证券	2021062200011688	大富科技	2021-06-22	431,280.00	36,000.00	14	3.50	587.02	-	-
中信证券	2021062200011690	新易盛	2021-06-22	1,498,791.00	47,900.00	14	3.00	1,748.59	-	-
中信证券	2021062200011692	新易盛	2021-06-22	312,900.00	10,000.00	14	3.00	365.05	-	-
中信证券	2021062200011694	天孚通信	2021-06-22	483,000.00	10,000.00	14	3.50	657.42	-	-
中信证券	2021062200011696	东方国信	2021-06-22	1,663,740.00	158,000.00	14	4.10	2,652.74	-	-
中信证券	2021062200011698	蓝思科技	2021-06-22	5,024,950.00	171,500.00	14	3.60	7,034.93	-	-
中	2021062200011	蓝	2021-06-	2,930,000.0	100,000.0	14	3.60	4,102.00	-	-

信 证 券	700	思 科 技	22	0	0					
中 信 证 券	2021062200011 702	蓝 思 科 技	2021-06- 22	990,340.00	33,800.00	14	3.60	1,386.48	-	-
中 信 证 券	2021062200011 704	蓝 思 科 技	2021-06- 22	4,143,020.0 0	141,400.0 0	14	3.60	5,800.23	-	-
中 信 证 券	2021062200011 706	长 盈 精 密	2021-06- 22	503,500.00	26,500.00	14	3.30	646.16	-	-
中 信 证 券	2021062200011 710	光 环 新 网	2021-06- 22	641,630.00	41,800.00	14	3.40	848.38	-	-
中 信 证 券	2021062400001 153	广 和 通	2021-06- 24	1,558,200.0 0	35,000.00	14	3.60	2,181.48	-	-
中 信 证 券	2021062400001 153	广 和 通	2021-06- 24	1,558,200.0 0	35,000.00	14	3.60	2,960.58	-	-
中 信 证 券	2021062400001 155	中 科 创 达	2021-06- 24	1,504,910.0 0	11,000.00	14	3.40	1,989.83	-	-
中 信 证 券	2021062400001 159	长 盈 精 密	2021-06- 24	1,475,910.0 0	69,000.00	14	3.50	2,008.88	-	-
中 信 证 券	2021062400001 163	新 易 盛	2021-06- 24	1,487,080.0 0	47,000.00	14	3.30	1,908.42	-	-
中 信 证 券	2021062400001 167	新 易 盛	2021-06- 24	965,020.00	30,500.00	28	3.20	1,972.93	-	-
中 信	2021062400001 171	中 际	2021-06- 24	1,544,060.0 0	41,000.00	14	3.50	2,101.64	-	-

证 券		旭 创								
中 信 证 券	2021062400008 983	电 连 技 术	2021-06- 24	1,367,154.0 0	50,300.00	14	3.50	1,860.85	-	-
中 信 证 券	2021062400008 985	大 富 科 技	2021-06- 24	4,108,030.0 0	337,000.0 0	14	3.50	5,591.49	-	-
中 信 证 券	2021062400008 987	光 弘 科 技	2021-06- 24	120,300.00	10,000.00	14	3.50	163.74	-	-
中 信 证 券	2021062400008 989	中 际 旭 创	2021-06- 24	3,766,000.0 0	100,000.0 0	14	2.90	4,247.21	-	-
中 信 证 券	2021062400008 991	光 弘 科 技	2021-06- 24	120,300.00	10,000.00	14	3.50	163.74	-	-
中 信 证 券	2021062400008 993	光 弘 科 技	2021-06- 24	192,480.00	16,000.00	14	3.50	261.99	-	-
中 信 证 券	2021062400008 995	广 和 通	2021-06- 24	445,200.00	10,000.00	14	3.50	605.97	-	-
中 信 证 券	2021062400008 995	广 和 通	2021-06- 24	445,200.00	10,000.00	14	3.50	822.38	-	-
中 信 证 券	2021062400008 997	大 富 科 技	2021-06- 24	689,954.00	56,600.00	14	3.50	939.10	-	-
中 信 证 券	2021062400008 999	长 盈 精 密	2021-06- 24	1,604,250.0 0	75,000.00	14	3.30	2,058.79	-	-
中 信 证 券	2021062400009 001	长 盈 精 密	2021-06- 24	342,240.00	16,000.00	14	3.30	439.21	-	-

券		密								
中信 证券	2021062400009 003	光 环 新 网	2021-06- 24	2,085,000.0 0	139,000.0 0	14	3.40	2,756.83	-	-
中信 证券	2021062400010 029	天 孚 通 信	2021-06- 17	1,200.00	-	14	3.40	-	-	-
中信 证券	2021062400010 031	天 孚 通 信	2021-06- 17	6,000.00	-	14	3.40	-	-	-
中信 证券	2021062400010 033	天 孚 通 信	2021-06- 22	6,000.00	-	14	3.50	-	-	-
中信 证券	2021062400010 037	天 孚 通 信	2021-06- 17	1,200.00	-	14	3.40	-	-	-
中信 证券	2021062400010 040	天 孚 通 信	2021-06- 22	1,200.00	-	14	3.80	-	-	-
中信 证券	2021062400010 045	天 孚 通 信	2021-06- 17	-	1,600.00	14	3.40	-	-	-
中信 证券	2021062400010 047	天 孚 通 信	2021-06- 17	-	8,000.00	14	3.40	-	-	-
中信 证券	2021062400010 049	天 孚 通 信	2021-06- 22	-	8,000.00	14	3.50	-	-	-
中信 证券	2021062400010 053	天 孚 通 信	2021-06- 17	-	1,600.00	14	3.40	-	-	-
中信 证券	2021062400010 056	天 孚 通 信	2021-06- 22	-	1,600.00	14	3.80	-	-	-

中信证券	2021062900001149	中际旭创	2021-06-29	1,496,040.00	39,000.00	14	3.50	2,036.28	-	-
中信证券	2021062900001161	网宿科技	2021-06-29	1,464,120.00	249,000.00	14	3.50	1,992.83	-	-
中信证券	2021062900001167	中科创达	2021-06-29	1,487,400.00	10,000.00	14	3.80	2,198.05	-	-
中信证券	2021062900001169	圣邦股份	2021-06-29	2,309,900.00	10,000.00	28	3.30	3,811.34	-	-
中信证券	2021062900001171	长盈精密	2021-06-29	206,300.00	10,000.00	14	3.50	280.80	-	-
中信证券	2021062900001793	网宿科技	2021-06-29	2,940,000.00	500,000.00	14	3.50	4,001.67	-	-
中信证券	2021062900001795	东方国信	2021-06-29	1,926,660.00	163,000.00	14	3.60	2,697.32	-	-
中信证券	2021062900001797	大富科技	2021-06-29	1,842,960.00	168,000.00	14	3.60	2,580.14	-	-
中信证券	2021062900001799	光环新网	2021-06-29	1,403,360.00	98,000.00	14	3.50	1,910.13	-	-
中信证券	20210629000018001	新易盛	2021-06-29	1,424,160.00	46,000.00	14	3.30	1,827.67	-	-
中信证券	20210629000018003	蓝思科技	2021-06-29	7,465,000.00	250,000.00	14	3.50	10,160.69	-	-
中	20210629000018	中	2021-06-	1,487,400.0	10,000.00	14	3.40	1,966.67	-	-

信 证 券	005	科 创 达	29	0						
中 信 证 券	2021062900018 007	蓝 思 科 技	2021-06- 29	298,600.00	10,000.00	14	3.50	406.43	-	-
中 信 证 券	2021070100000 812	长 盈 精 密	2021-07- 01	1,962,225.0 0	96,900.00	28	3.40	5,189.00	-	-
中 信 证 券	2021070100000 824	信 维 通 信	2021-07- 01	296,600.00	10,000.00	14	3.40	392.17	-	-
中 信 证 券	2021070100000 828	蓝 思 科 技	2021-07- 01	6,090,000.0 0	200,000.0 0	14	3.40	8,052.33	-	-
中 信 证 券	2021070100000 832	电 连 技 术	2021-07- 01	1,499,160.0 0	52,000.00	14	3.60	2,098.82	-	-
中 信 证 券	2021070100015 804	天 孚 通 信	2021-07- 01	48,380.00	2,000.00	14	3.80	71.49	-	-
中 信 证 券	2021070100015 806	天 孚 通 信	2021-07- 01	48,380.00	2,000.00	14	3.80	71.49	-	-
中 信 证 券	2021070100015 808	光 环 新 网	2021-07- 01	175,625.00	12,500.00	14	3.50	239.05	-	-
中 信 证 券	2021070100015 810	东 方 国 信	2021-07- 01	1,335,945.0 0	110,500.0 0	14	3.60	1,870.32	-	-
中 信 证 券	2021070100015 812	蓝 思 科 技	2021-07- 01	913,500.00	30,000.00	14	3.50	1,243.38	-	-
中 信	2021070100015 814	蓝 思	2021-07- 01	1,501,185.0 0	49,300.00	14	3.50	2,043.28	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021070100015 816	天 孚 通 信	2021-07- 01	241,900.00	10,000.00	14	3.80	357.47	-	-
中 信 证 券	2021070100015 818	蓝 思 科 技	2021-07- 01	2,302,020.0 0	75,600.00	14	3.50	3,133.31	-	-
中 信 证 券	2021070100015 820	东 方 国 信	2021-07- 01	1,209,000.0 0	100,000.0 0	14	3.60	1,692.60	-	-
中 信 证 券	2021070100015 822	大 富 科 技	2021-07- 01	106,000.00	10,000.00	14	3.60	148.40	-	-
中 信 证 券	2021070100015 824	信 维 通 信	2021-07- 01	1,423,680.0 0	48,000.00	14	3.40	1,882.42	-	-
中 信 证 券	2021070100015 826	长 盈 精 密	2021-07- 01	1,138,050.0 0	56,200.00	14	3.50	1,549.01	-	-
中 信 证 券	2021070100015 828	大 富 科 技	2021-07- 01	670,980.00	63,300.00	14	3.60	939.37	-	-
中 信 证 券	2021070100015 830	蓝 思 科 技	2021-07- 01	511,560.00	16,800.00	28	3.40	1,352.79	-	-
中 信 证 券	2021070100015 840	光 弘 科 技	2021-07- 01	138,000.00	12,000.00	14	3.40	182.47	-	-
中 信 证 券	2021070100015 842	圣 邦 股 份	2021-07- 01	10,170,368. 00	41,600.00	14	3.40	13,447.49	-	-
中 信 证 券	2021070100015 844	新 易 盛	2021-07- 01	1,100,380.0 0	37,000.00	14	3.30	1,412.15	-	-

券										
中信 证券	2021070100015 846	广和通	2021-07-01	45,360.00	1,000.00	14	3.60	63.50	-	-
中信 证券	2021070100015 850	光弘科技	2021-07-01	483,000.00	42,000.00	14	3.40	638.63	-	-
中信 证券	2021070200001 121	中科创达	2021-07-02	1,248,160.0 0	18,800.00	7	3.90	2,224.33	-	-
中信 证券	2021070200001 141	蓝思科技	2021-07-02	1,153,200.0 0	94,200.00	7	3.50	1,848.24	-	-
中信 证券	2021070200001 153	卓胜微	2021-07-02	3,058,260.0 0	14,100.00	7	3.40	4,751.35	-	-
中信 证券	2021070200001 225	芒果超媒	2021-07-02	1,233,290.0 0	44,800.00	7	3.50	1,979.03	-	-
中信 证券	2021070200001 233	信维通信	2021-07-02	768,560.00	61,200.00	7	3.50	1,231.17	-	-
中信 证券	2021070600010 810	蓝思科技	2021-07-06	962,962.00	33,800.00	14	3.40	1,273.25	-	-
中信 证券	2021070600010 826	长盈精密	2021-07-06	1,680,750.0 0	83,000.00	14	3.50	2,287.69	-	-
中信 证券	2021070600010 828	中际旭创	2021-07-06	1,374,840.0 0	38,000.00	14	3.50	1,871.31	-	-
中信 证券	2021070600010 830	蓝思科技	2021-07-06	4,028,486.0 0	141,400.0 0	14	3.40	5,326.55	-	-

中信证券	2021070600010832	天孚通信	2021-07-06	46,620.00	2,000.00	14	3.90	70.71	-	-
中信证券	2021070600010834	中际旭创	2021-07-06	911,736.00	25,200.00	14	3.50	1,240.97	-	-
中信证券	2021070600010836	大富科技	2021-07-06	386,400.00	34,500.00	14	3.50	525.93	-	-
中信证券	2021070600010838	蓝思科技	2021-07-06	4,886,035.00	171,500.00	14	3.40	6,460.42	-	-
中信证券	2021070600010840	光环新网	2021-07-06	598,158.00	41,800.00	14	3.50	814.16	-	-
中信证券	2021070600010842	新易盛	2021-07-06	288,000.00	10,000.00	14	3.40	380.80	-	-
中信证券	2021070600010844	天孚通信	2021-07-06	233,100.00	10,000.00	14	3.90	353.54	-	-
中信证券	2021070600010846	长盈精密	2021-07-06	536,625.00	26,500.00	14	3.50	730.41	-	-
中信证券	2021070600010848	大富科技	2021-07-06	403,200.00	36,000.00	14	3.50	548.80	-	-
中信证券	2021070600010850	大富科技	2021-07-06	310,240.00	27,700.00	14	3.50	422.27	-	-
中信证券	2021070600010852	新易盛	2021-07-06	1,379,520.00	47,900.00	14	3.40	1,824.03	-	-
中	2021070600010	东	2021-07-	1,884,940.0	158,000.0	14	3.50	2,565.61	-	-

信 证 券	854	方 国 信	06	0	0					
中 信 证 券	2021070600011 388	蓝 思 科 技	2021-07- 06	2,849,000.0 0	100,000.0 0	14	3.40	3,767.01	-	-
中 信 证 券	2021070800007 611	光 环 新 网	2021-07- 08	1,933,490.0 0	139,000.0 0	14	3.50	2,631.69	-	-
中 信 证 券	2021070800007 621	长 盈 精 密	2021-07- 08	1,596,750.0 0	75,000.00	14	3.50	2,173.35	-	-
中 信 证 券	2021070800007 623	蓝 思 科 技	2021-07- 08	1,182,440.0 0	41,000.00	28	3.30	3,034.93	-	-
中 信 证 券	2021070800008 153	光 弘 科 技	2021-07- 08	183,200.00	16,000.00	14	3.40	242.23	-	-
中 信 证 券	2021070800008 155	大 富 科 技	2021-07- 08	625,996.00	56,600.00	14	3.50	852.05	-	-
中 信 证 券	2021070800008 157	光 弘 科 技	2021-07- 08	114,500.00	10,000.00	14	3.40	151.39	-	-
中 信 证 券	2021070800008 159	光 弘 科 技	2021-07- 08	114,500.00	10,000.00	14	3.40	151.39	-	-
中 信 证 券	2021070800008 161	大 富 科 技	2021-07- 08	3,727,220.0 0	337,000.0 0	14	3.50	5,073.16	-	-
中 信 证 券	2021070800008 163	中 际 旭 创	2021-07- 08	1,474,360.0 0	41,000.00	14	3.50	2,006.77	-	-
中 信	2021070800008 165	电 连	2021-07- 08	1,484,353.0 0	50,300.00	14	3.60	2,078.09	-	-

证券		技术								
中信证券	2021070800008167	中际旭创	2021-07-08	5,753,600.00	160,000.00	28	3.40	15,215.08	-	-
中信证券	2021070800008169	中际旭创	2021-07-08	3,596,000.00	100,000.00	14	3.50	4,894.56	-	-
中信证券	2021070900006247	蓝思科技	2021-07-09	1,128,000.00	40,000.00	7	3.00	658.00	-	-
中信证券	2021070900006249	芒果超媒	2021-07-09	1,088,320.00	19,000.00	7	3.20	677.18	-	-
中信证券	2021070900006253	卓胜微	2021-07-09	2,914,800.00	6,000.00	7	2.70	1,530.27	-	-
中信证券	2021070900006255	中科创达	2021-07-09	1,257,440.00	8,000.00	7	2.80	684.61	-	-
中信证券	2021070900006257	信维通信	2021-07-09	823,680.00	26,000.00	7	2.90	464.46	-	-
中信证券	2021071300020115	广和通	2021-07-13	1,732,500.00	35,000.00	14	3.70	2,492.88	-	-
中信证券	2021071300020361	广和通	2021-07-13	495,000.00	10,000.00	14	3.70	712.25	-	-
中信证券	2021071300021391	蓝思科技	2021-07-13	6,762,500.00	250,000.00	14	2.90	7,626.60	-	-
中信证	2021071300021393	蓝思科	2021-07-13	270,500.00	10,000.00	14	2.90	305.06	-	-

券		技								
中信证券	2021071300021 395	大富科技	2021-07-13	1,895,040.00	168,000.00	14	3.60	2,653.06	-	-
中信证券	2021071300021 397	东方国信	2021-07-13	1,936,440.00	163,000.00	14	3.60	2,711.02	-	-
中信证券	2021071300021 399	新易盛	2021-07-13	1,724,080.00	46,000.00	14	3.70	2,480.76	-	-
中信证券	2021071300021 401	中科创达	2021-07-13	1,506,100.00	10,000.00	14	2.70	1,581.41	-	-
中信证券	2021071300021 403	网宿科技	2021-07-13	3,110,000.00	500,000.00	14	3.40	4,112.11	-	-
中信证券	2021071300021 405	网宿科技	2021-07-13	1,548,780.00	249,000.00	14	3.40	2,047.83	-	-
中信证券	2021071500014 990	广和通	2021-07-15	52,520.00	1,000.00	14	3.60	73.53	-	-
中信证券	2021071500016 332	蓝思科技	2021-07-15	5,392,000.00	200,000.00	14	2.90	6,080.98	-	-
中信证券	2021071500016 334	蓝思科技	2021-07-15	2,038,176.00	75,600.00	14	2.90	2,298.61	-	-
中信证券	2021071500016 336	新易盛	2021-07-15	1,373,070.00	37,000.00	14	3.70	1,975.70	-	-
中信证券	2021071500016 338	蓝思科技	2021-07-15	1,329,128.00	49,300.00	14	2.90	1,498.96	-	-

中信 证 券	2021071500016 340	光 环 新 网	2021-07- 15	190,750.00	12,500.00	14	3.40	252.21	-	-
中信 证 券	2021071500016 344	天 孚 通 信	2021-07- 15	51,300.00	2,000.00	14	4.10	81.80	-	-
中信 证 券	2021071500016 346	天 孚 通 信	2021-07- 15	256,500.00	10,000.00	14	4.10	408.98	-	-
中信 证 券	2021071500016 348	天 孚 通 信	2021-07- 15	51,300.00	2,000.00	14	4.10	81.80	-	-
中信 证 券	2021071500016 350	圣 邦 股 份	2021-07- 15	10,115,456. 00	41,600.00	14	3.10	12,194.74	-	-
中信 证 券	2021071500016 352	电 连 技 术	2021-07- 15	1,812,200.0 0	52,000.00	14	3.70	2,607.55	-	-
中信 证 券	2021071500016 354	光 弘 科 技	2021-07- 15	493,500.00	42,000.00	14	3.60	690.90	-	-
中信 证 券	2021071500016 356	光 弘 科 技	2021-07- 15	141,000.00	12,000.00	14	3.60	197.40	-	-
中信 证 券	2021071500016 358	信 维 通 信	2021-07- 15	316,100.00	10,000.00	14	2.80	344.20	-	-
中信 证 券	2021071500016 360	信 维 通 信	2021-07- 15	1,517,280.0 0	48,000.00	14	2.80	1,652.15	-	-
中信 证 券	2021071500016 362	东 方 国 信	2021-07- 15	1,168,000.0 0	100,000.0 0	14	3.60	1,635.20	-	-
中	2021071500016	东	2021-07-	1,290,640.0	110,500.0	14	3.60	1,806.90	-	-

信 证 券	368	方 国 信	15	0	0					
中 信 证 券	2021071500016 370	长 盈 精 密	2021-07- 15	1,061,056.0 0	56,200.00	14	3.50	1,444.22	-	-
中 信 证 券	2021071500016 372	大 富 科 技	2021-07- 15	113,600.00	10,000.00	14	3.60	159.04	-	-
中 信 证 券	2021071500016 374	大 富 科 技	2021-07- 15	719,088.00	63,300.00	14	3.60	1,006.72	-	-
中 信 证 券	2021071500017 942	蓝 思 科 技	2021-07- 15	70,000.00	-	14	2.90	-	-	-
中 信 证 券	2021071500017 944	蓝 思 科 技	2021-07- 15	26,460.00	-	14	2.90	-	-	-
中 信 证 券	2021071500017 946	蓝 思 科 技	2021-07- 15	17,255.00	-	14	2.90	-	-	-
中 信 证 券	2021071500017 996	蓝 思 科 技	2021-07- 13	3,500.00	-	14	2.90	-	-	-
中 信 证 券	2021071500018 006	蓝 思 科 技	2021-07- 13	87,500.00	-	14	2.90	-	-	-
中 信 证 券	2021071500018 036	蓝 思 科 技	2021-07- 09	14,000.00	-	7	3.00	-	-	-
中 信 证 券	2021071500018 050	蓝 思 科 技	2021-07- 08	14,350.00	-	28	3.30	-	-	-
中 信	2021071500018 132	蓝 思	2021-07- 06	35,000.00	-	14	3.40	-	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021071500018 134	蓝 思 科 技	2021-07- 06	60,025.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	2021071500018 142	蓝 思 科 技	2021-07- 06	11,830.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	2021071500018 144	蓝 思 科 技	2021-07- 06	49,490.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	2021071500018 224	蓝 思 科 技	2021-07- 01	5,880.00	-	28	3.40	-	-	-
中 信 证 券	2021072000013 555	中 际 旭 创	2021-07- 20	854,028.00	25,200.00	14	3.30	1,096.00	-	-
中 信 证 券	2021072000013 557	东 方 国 信	2021-07- 20	1,717,460.0 0	158,000.0 0	14	3.50	2,337.65	-	-
中 信 证 券	2021072000013 559	大 富 科 技	2021-07- 20	440,640.00	36,000.00	14	3.50	599.76	-	-
中 信 证 券	2021072000013 561	光 环 新 网	2021-07- 20	652,498.00	41,800.00	14	3.40	862.75	-	-
中 信 证 券	2021072000013 563	蓝 思 科 技	2021-07- 20	885,222.00	33,800.00	14	2.80	963.91	-	-
中 信 证 券	2021072000013 565	天 孚 通 信	2021-07- 20	55,460.00	2,000.00	14	3.60	77.64	-	-
中 信 证 券	2021072000013 567	天 孚 通	2021-07- 20	277,300.00	10,000.00	14	3.60	388.22	-	-

券		信								
中信 证券	2021072000013 569	大富 科技	2021-07- 20	339,048.00	27,700.00	14	3.50	461.48	-	-
中信 证券	2021072000013 571	大富 科技	2021-07- 20	422,280.00	34,500.00	14	3.50	574.77	-	-
中信 证券	2021072000013 573	长盈 精密	2021-07- 20	503,500.00	26,500.00	14	3.40	665.74	-	-
中信 证券	2021072000013 575	蓝思 科技	2021-07- 20	4,491,585.0 0	171,500.0 0	14	2.80	4,890.84	-	-
中信 证券	2021072000013 577	新易 盛	2021-07- 20	1,786,191.0 0	47,900.00	14	3.50	2,431.20	-	-
中信 证券	2021072000013 579	蓝思 科技	2021-07- 20	2,619,000.0 0	100,000.0 0	14	2.80	2,851.80	-	-
中信 证券	2021072000013 581	蓝思 科技	2021-07- 20	3,703,266.0 0	141,400.0 0	14	2.80	4,032.45	-	-
中信 证券	2021072200007 846	光弘 科技	2021-07- 22	121,200.00	10,000.00	28	3.50	329.93	-	-
中信 证券	2021072200007 848	中际 旭创	2021-07- 22	3,471,000.0 0	100,000.0 0	28	3.20	8,638.93	-	-
中信 证券	2021072200007 850	光弘 科技	2021-07- 22	121,200.00	10,000.00	28	3.50	329.93	-	-
中信 证券	2021072200007 852	新易 盛	2021-07- 22	1,141,920.0 0	30,500.00	28	3.40	3,019.74	-	-

中信证券	2021072200007854	电连技术	2021-07-22	1,952,143.00	50,300.00	28	3.50	5,314.17	-	-
中信证券	2021072200007856	光环新网	2021-07-22	2,139,210.00	139,000.00	28	3.30	5,490.64	-	-
中信证券	2021072200007858	长盈精密	2021-07-22	1,443,750.00	75,000.00	28	3.30	3,705.63	-	-
中信证券	2021072200007860	大富科技	2021-07-22	671,842.00	56,600.00	28	3.40	1,776.65	-	-
中信证券	2021072200007862	光弘科技	2021-07-22	193,920.00	16,000.00	28	3.50	527.89	-	-
中信证券	2021072200007864	大富科技	2021-07-22	4,000,190.00	337,000.00	28	3.40	10,578.28	-	-
中信证券	2021072300000830	芒果超媒	2021-07-23	957,322.00	16,600.00	14	1.80	670.13	-	-
中信证券	2021072700018697	东方国信	2021-07-27	1,722,910.00	163,000.00	28	3.10	4,154.13	-	-
中信证券	2021072700018699	新易盛	2021-07-27	1,892,900.00	46,000.00	28	3.50	5,152.89	-	-
中信证券	2021072700018701	中科创达	2021-07-27	1,334,900.00	10,000.00	28	2.40	2,491.81	-	-
中信证券	2021072700018703	广和通	2021-07-27	2,075,500.00	35,000.00	28	3.40	5,488.54	-	-
中	2021072700018	广	2021-07-	593,000.00	10,000.00	28	3.40	1,568.16	-	-

信 证 券	705	和 通	27							
中 信 证 券	2021072700018 707	蓝 思 科 技	2021-07- 27	251,000.00	10,000.00	28	2.30	449.01	-	-
中 信 证 券	2021072700018 709	蓝 思 科 技	2021-07- 27	6,275,000.0 0	250,000.0 0	28	2.30	11,225.28	-	-
中 信 证 券	2021072700018 711	圣 邦 股 份	2021-07- 27	2,834,100.0 0	10,000.00	28	2.20	4,849.46	-	-
中 信 证 券	2021072700018 713	网 宿 科 技	2021-07- 27	2,960,000.0 0	500,000.0 0	28	3.50	8,057.78	-	-
中 信 证 券	2021072700018 715	网 宿 科 技	2021-07- 27	1,474,080.0 0	249,000.0 0	28	3.50	4,012.77	-	-
中 信 证 券	2021072700019 151	大 富 科 技	2021-07- 27	1,869,840.0 0	168,000.0 0	28	3.50	5,090.12	-	-
中 信 证 券	2021072900001 348	电 连 技 术	2021-07- 29	1,829,000.0 0	50,000.00	14	3.60	2,560.60	-	-
中 信 证 券	2021072900001 350	天 孚 通 信	2021-07- 29	549,280.00	16,000.00	14	3.70	790.35	-	-
中 信 证 券	2021072900001 352	光 弘 科 技	2021-07- 29	121,440.00	9,600.00	28	3.20	302.25	-	-
中 信 证 券	2021072900001 358	硕 贝 德	2021-07- 29	1,371,000.0 0	100,000.0 0	14	3.50	1,866.08	-	-
中 信	2021072900001 364	新 易	2021-07- 29	617,680.00	14,000.00	14	3.50	840.73	-	-

证 券		盛								
中 信 证 券	2021072900015 719	东 方 国 信	2021-07- 29	1,207,765.0 0	110,500.0 0	28	3.10	2,912.06	-	-
中 信 证 券	2021072900015 721	信 维 通 信	2021-07- 29	1,262,880.0 0	48,000.00	28	2.60	2,553.82	-	-
中 信 证 券	2021072900015 723	信 维 通 信	2021-07- 29	263,100.00	10,000.00	28	2.60	532.05	-	-
中 信 证 券	2021072900015 725	东 方 国 信	2021-07- 29	1,093,000.0 0	100,000.0 0	28	3.10	2,635.34	-	-
中 信 证 券	2021072900015 727	长 盈 精 密	2021-07- 29	1,755,828.0 0	96,900.00	28	3.20	4,370.06	-	-
中 信 证 券	2021072900016 687	大 富 科 技	2021-07- 29	112,000.00	10,000.00	28	3.50	304.89	-	-
中 信 证 券	2021072900016 689	大 富 科 技	2021-07- 29	708,960.00	63,300.00	28	3.50	1,929.95	-	-
中 信 证 券	2021072900016 691	蓝 思 科 技	2021-07- 29	5,002,000.0 0	200,000.0 0	28	2.30	8,948.02	-	-
中 信 证 券	2021072900016 693	天 孚 通 信	2021-07- 29	68,660.00	2,000.00	28	3.60	192.25	-	-
中 信 证 券	2021072900016 695	蓝 思 科 技	2021-07- 29	420,168.00	16,800.00	28	2.30	751.63	-	-
中 信 证 券	2021072900016 697	蓝 思 科 技	2021-07- 29	1,890,756.0 0	75,600.00	28	2.30	3,382.35	-	-

券		技								
中信证券	2021072900016701	光环新网	2021-07-29	191,375.00	12,500.00	28	1.90	282.81	-	-
中信证券	2021072900016703	天孚通信	2021-07-29	68,660.00	2,000.00	28	3.60	192.25	-	-
中信证券	2021072900016705	天孚通信	2021-07-29	343,300.00	10,000.00	28	3.60	961.24	-	-
中信证券	2021072900016707	光弘科技	2021-07-29	151,800.00	12,000.00	28	3.50	413.23	-	-
中信证券	2021072900016709	光弘科技	2021-07-29	531,300.00	42,000.00	28	3.50	1,446.32	-	-
中信证券	2021072900016711	电连技术	2021-07-29	1,902,160.00	52,000.00	28	3.60	5,326.05	-	-
中信证券	2021072900016713	新易盛	2021-07-29	1,632,440.00	37,000.00	28	3.50	4,443.86	-	-
中信证券	2021072900016715	蓝思科技	2021-07-29	1,232,993.00	49,300.00	28	2.30	2,205.69	-	-
中信证券	2021072900016717	圣邦股份	2021-07-29	13,831,168.00	41,600.00	28	2.20	23,666.67	-	-
中信证券	2021072900016719	广和通	2021-07-29	59,900.00	1,000.00	28	3.40	158.40	-	-
中信证券	2021080300000851	光弘科技	2021-08-03	1,951,680.00	152,000.00	14	3.30	2,504.66	-	-

中信证券	2021080300000865	电连技术	2021-08-03	3,030,300.00	81,900.00	14	3.70	4,360.27	-	-
中信证券	2021080300000867	硕贝德	2021-08-03	2,118,400.00	160,000.00	14	3.60	2,965.76	-	-
中信证券	2021080300013214	天孚通信	2021-08-03	67,700.00	2,000.00	14	3.70	97.41	-	-
中信证券	2021080300013216	大富科技	2021-08-03	419,760.00	36,000.00	14	3.50	571.34	-	-
中信证券	2021080300013218	长盈精密	2021-08-03	456,595.00	26,500.00	14	2.90	514.94	-	-
中信证券	2021080300013220	中际旭创	2021-08-03	1,067,976.00	25,200.00	14	3.30	1,370.57	-	-
中信证券	2021080300013222	东方国信	2021-08-03	1,831,220.00	158,000.00	14	3.50	2,492.49	-	-
中信证券	2021080300013224	蓝思科技	2021-08-03	3,573,178.00	141,400.00	14	2.90	4,029.75	-	-
中信证券	2021080300013226	新易盛	2021-08-03	2,241,241.00	47,900.00	14	3.50	3,050.58	-	-
中信证券	2021080300013228	大富科技	2021-08-03	402,270.00	34,500.00	14	3.50	547.53	-	-
中信证券	2021080300013230	天孚通信	2021-08-03	338,500.00	10,000.00	14	3.70	487.06	-	-
中	2021080300013	大	2021-08-	322,982.00	27,700.00	14	3.50	439.61	-	-

信 证 券	232	富 科 技	03							
中 信 证 券	2021080300014 000	蓝 思 科 技	2021-08- 03	4,333,805.0 0	171,500.0 0	14	2.90	4,887.57	-	-
中 信 证 券	2021080300014 002	蓝 思 科 技	2021-08- 03	2,527,000.0 0	100,000.0 0	14	2.90	2,849.89	-	-
中 信 证 券	2021080300014 004	蓝 思 科 技	2021-08- 03	854,126.00	33,800.00	14	2.90	963.26	-	-
中 信 证 券	2021080500001 036	新 易 盛	2021-08- 05	2,323,000.0 0	50,000.00	14	3.50	3,161.86	-	-
中 信 证 券	2021080500001 038	硕 贝 德	2021-08- 05	397,500.00	30,000.00	14	3.60	556.50	-	-
中 信 证 券	2021080500001 040	东 方 国 信	2021-08- 05	779,580.00	71,000.00	14	3.40	1,030.78	-	-
中 信 证 券	2021080500001 062	网 宿 科 技	2021-08- 05	597,520.00	97,000.00	14	3.60	836.53	-	-
中 信 证 券	2021080500010 445	中 际 旭 创	2021-08- 05	6,723,200.0 0	160,000.0 0	28	3.20	16,733.30	-	-
中 信 证 券	2021080600009 192	芒 果 超 媒	2021-08- 06	874,820.00	16,600.00	14	1.80	218.71	-	-
中 信 证 券	2021081000001 020	天 孚 通 信	2021-08- 10	2,934,800.0 0	92,000.00	14	3.40	3,880.46	-	-
中 信	2021081000001 042	东 方	2021-08- 10	626,808.00	53,300.00	14	3.50	853.16	-	-

证 券		国 信								
中 信 证 券	2021081000002 998	芒 果 超 媒	2021-08- 06	966,950.00	16,600.00	5	1.80	218.71	-	-
中 信 证 券	2021081200000 895	圣 邦 股 份	2021-08- 12	2,118,720.0 0	6,000.00	14	2.70	2,224.66	-	-
中 信 证 券	2021081200000 903	信 维 通 信	2021-08- 12	1,866,900.0 0	70,000.00	14	3.00	2,178.05	-	-
中 信 证 券	2021081200000 907	中 际 旭 创	2021-08- 12	2,502,000.0 0	60,000.00	14	3.80	3,697.40	-	-
中 信 证 券	2021081200018 349	电 连 技 术	2021-08- 12	2,152,500.0 0	50,000.00	14	3.70	3,097.21	-	-
中 信 证 券	2021081200018 351	新 易 盛	2021-08- 12	553,000.00	14,000.00	14	3.50	752.69	-	-
中 信 证 券	2021081200018 353	天 孚 通 信	2021-08- 12	521,920.00	16,000.00	14	3.80	771.28	-	-
中 信 证 券	2021081200018 355	硕 贝 德	2021-08- 12	1,341,000.0 0	100,000.0 0	14	3.60	1,877.40	-	-
中 信 证 券	2021081700000 895	信 维 通 信	2021-08- 17	307,200.00	12,000.00	14	2.90	346.45	-	-
中 信 证 券	2021081700000 903	中 际 旭 创	2021-08- 17	2,368,800.0 0	60,000.00	14	3.90	3,592.68	-	-
中 信 证 券	2021081700012 924	光 弘 科	2021-08- 17	1,868,080.0 0	152,000.0 0	14	3.40	2,470.02	-	-

券		技								
中信 证券	2021081700012 926	电 连 技 术	2021-08- 17	3,278,457.0 0	81,900.00	14	3.80	4,844.83	-	-
中信 证券	2021081700012 930	大 富 科 技	2021-08- 17	293,620.00	27,700.00	14	3.50	399.65	-	-
中信 证券	2021081700012 932	大 富 科 技	2021-08- 17	381,600.00	36,000.00	14	3.50	519.40	-	-
中信 证券	2021081700012 934	大 富 科 技	2021-08- 17	365,700.00	34,500.00	14	3.50	497.76	-	-
中信 证券	2021081700012 936	长 盈 精 密	2021-08- 17	457,125.00	26,500.00	14	3.40	604.42	-	-
中信 证券	2021081700012 938	天 孚 通 信	2021-08- 17	285,400.00	10,000.00	14	3.40	377.36	-	-
中信 证券	2021081700012 940	天 孚 通 信	2021-08- 17	57,080.00	2,000.00	14	3.40	75.47	-	-
中信 证券	2021081700012 942	新 易 盛	2021-08- 17	1,758,888.0 0	47,900.00	14	3.50	2,394.04	-	-
中信 证券	2021081700012 944	东 方 国 信	2021-08- 17	1,635,300.0 0	158,000.0 0	14	3.50	2,225.83	-	-
中信 证券	2021081700012 946	中 际 旭 创	2021-08- 17	994,896.00	25,200.00	14	3.80	1,470.24	-	-
中信 证券	2021081700012 948	硕 贝 德	2021-08- 17	1,972,800.0 0	160,000.0 0	14	3.60	2,761.92	-	-

中信证券	2021081900001494	广和通	2021-08-19	3,215,320.00	62,000.00	14	3.70	4,626.49	-	-
中信证券	2021081900001496	天孚通信	2021-08-19	270,450.00	9,000.00	14	3.50	368.11	-	-
中信证券	2021081900001502	中际旭创	2021-08-19	2,004,600.00	52,000.00	14	3.90	3,040.31	-	-
中信证券	2021081900001506	圣邦股份	2021-08-19	4,393,350.00	13,000.00	14	3.30	5,638.13	-	-
中信证券	2021081900009575	大富科技	2021-08-19	3,639,600.00	337,000.00	28	3.40	9,624.72	-	-
中信证券	2021081900009577	光环新网	2021-08-19	2,133,650.00	139,000.00	28	3.40	5,642.32	-	-
中信证券	2021081900009579	新易盛	2021-08-19	1,906,500.00	50,000.00	14	3.50	2,594.96	-	-
中信证券	2021081900009581	新易盛	2021-08-19	1,162,965.00	30,500.00	28	3.40	3,075.40	-	-
中信证券	2021081900009583	硕贝德	2021-08-19	384,300.00	30,000.00	14	3.60	538.02	-	-
中信证券	2021081900009585	大富科技	2021-08-19	611,280.00	56,600.00	28	3.40	1,616.50	-	-
中信证券	2021081900009587	东方国信	2021-08-19	724,910.00	71,000.00	14	3.50	986.68	-	-
中	2021081900009	中	2021-08-	3,855,000.0	100,000.0	28	3.70	11,093.83	-	-

信 证 券	589	际 旭 创	19	0	0					
中 信 证 券	2021081900011 645	光 弘 科 技	2021-08- 19	196,160.00	16,000.00	28	3.30	503.48	-	-
中 信 证 券	2021081900011 647	光 弘 科 技	2021-08- 19	122,600.00	10,000.00	28	3.30	314.67	-	-
中 信 证 券	2021081900011 649	光 弘 科 技	2021-08- 19	122,600.00	10,000.00	28	3.30	314.67	-	-
中 信 证 券	2021081900011 653	电 连 技 术	2021-08- 19	1,930,011.0 0	50,300.00	28	3.70	5,554.14	-	-
中 信 证 券	2021081900011 655	网 宿 科 技	2021-08- 19	620,800.00	97,000.00	14	3.60	869.12	-	-
中 信 证 券	2021082400001 179	天 孚 通 信	2021-08- 24	803,880.00	29,000.00	14	3.60	1,125.43	-	-
中 信 证 券	2021082400018 363	网 宿 科 技	2021-08- 24	3,095,000.0 0	500,000.0 0	28	3.50	8,726.18	-	-
中 信 证 券	2021082400018 367	网 宿 科 技	2021-08- 24	1,541,310.0 0	249,000.0 0	28	3.50	4,345.64	-	-
中 信 证 券	2021082400018 379	大 富 科 技	2021-08- 24	1,814,400.0 0	168,000.0 0	28	3.40	4,969.44	-	-
中 信 证 券	2021082400018 381	东 方 国 信	2021-08- 24	550,056.00	53,300.00	14	3.60	770.08	-	-
中 信	2021082400018 385	天 孚	2021-08- 24	2,550,240.0 0	92,000.00	14	3.50	3,471.16	-	-

证 券		通 信								
中 信 证 券	2021082400018 399	广 和 通	2021-08- 24	1,758,750.0 0	35,000.00	28	3.60	5,100.38	-	-
中 信 证 券	2021082400018 401	广 和 通	2021-08- 24	502,500.00	10,000.00	28	3.60	1,457.25	-	-
中 信 证 券	2021082400019 069	东 方 国 信	2021-08- 24	1,682,160.0 0	163,000.0 0	28	3.50	4,742.75	-	-
中 信 证 券	2021082400019 079	蓝 思 科 技	2021-08- 24	252,800.00	10,000.00	28	2.20	448.02	-	-
中 信 证 券	2021082400019 091	中 科 创 达	2021-08- 24	1,274,500.0 0	10,000.00	28	2.00	2,053.37	-	-
中 信 证 券	2021082400019 093	新 易 盛	2021-08- 24	1,740,640.0 0	46,000.00	28	3.40	4,767.42	-	-
中 信 证 券	2021082400019 105	圣 邦 股 份	2021-08- 24	3,660,000.0 0	10,000.00	28	3.20	9,434.66	-	-
中 信 证 券	2021082600000 904	圣 邦 股 份	2021-08- 26	2,502,080.0 0	8,000.00	14	3.50	3,405.61	-	-
中 信 证 券	2021082600001 062	网 宿 科 技	2021-08- 26	3,690,360.0 0	603,000.0 0	14	3.50	5,022.99	-	-
中 信 证 券	2021082600001 066	网 宿 科 技	2021-08- 26	1,107,720.0 0	181,000.0 0	14	3.50	1,507.73	-	-
中 信 证 券	2021082600001 072	新 易 盛	2021-08- 26	2,212,470.0 0	61,000.00	14	3.60	3,097.46	-	-

券										
中信 证券	2021082600015 391	硕 贝 德	2021-08- 26	1,308,000.0 0	100,000.0 0	14	3.50	1,780.33	-	-
中信 证券	2021082600015 393	中 际 旭 创	2021-08- 26	2,212,800.0 0	60,000.00	14	3.90	3,356.08	-	-
中信 证券	2021082600015 395	天 孚 通 信	2021-08- 26	434,560.00	16,000.00	14	3.50	591.48	-	-
中信 证券	2021082600015 397	信 维 通 信	2021-08- 26	232,800.00	10,000.00	28	2.80	506.99	-	-
中信 证券	2021082600015 399	光 环 新 网	2021-08- 26	178,875.00	12,500.00	28	3.30	459.11	-	-
中信 证券	2021082600015 401	东 方 国 信	2021-08- 26	1,089,530.0 0	110,500.0 0	28	3.50	2,965.94	-	-
中信 证券	2021082600015 403	信 维 通 信	2021-08- 26	1,117,440.0 0	48,000.00	28	2.80	2,433.54	-	-
中信 证券	2021082600015 405	东 方 国 信	2021-08- 26	986,000.00	100,000.0 0	28	3.50	2,684.11	-	-
中信 证券	2021082600015 407	新 易 盛	2021-08- 26	1,341,990.0 0	37,000.00	28	3.40	3,548.82	-	-
中信 证券	2021082600015 409	新 易 盛	2021-08- 26	507,780.00	14,000.00	14	3.50	691.15	-	-
中信 证券	2021082600015 413	圣 邦 股 份	2021-08- 26	1,876,560.0 0	6,000.00	14	3.30	2,408.25	-	-

中信证券	2021082600015415	广和通	2021-08-26	47,600.00	1,000.00	28	3.60	133.28	-	-
中信证券	2021082600015417	天孚通信	2021-08-26	54,320.00	2,000.00	28	3.40	143.65	-	-
中信证券	2021082600015419	蓝思科技	2021-08-26	4,840,000.00	200,000.00	28	2.20	8,281.78	-	-
中信证券	2021082600015421	天孚通信	2021-08-26	54,320.00	2,000.00	28	3.40	143.65	-	-
中信证券	2021082600015423	天孚通信	2021-08-26	271,600.00	10,000.00	28	3.40	718.23	-	-
中信证券	2021082600015427	长盈精密	2021-08-26	1,623,075.00	96,900.00	28	3.40	4,292.13	-	-
中信证券	2021082600015429	信维通信	2021-08-26	1,629,600.00	70,000.00	14	2.90	1,837.83	-	-
中信证券	2021082600015431	大富科技	2021-08-26	669,081.00	63,300.00	28	3.40	1,769.35	-	-
中信证券	2021082600015433	光弘科技	2021-08-26	114,720.00	9,600.00	28	3.30	294.45	-	-
中信证券	2021082600015435	光弘科技	2021-08-26	501,900.00	42,000.00	28	3.30	1,288.21	-	-
中信证券	2021082600015437	电连技术	2021-08-26	1,882,500.00	50,000.00	14	3.60	2,635.50	-	-
中	2021082600015	圣	2021-08-	13,010,816.	41,600.00	28	3.20	32,382.48	-	-

信 证 券	439	邦 股 份	26	00						
中 信 证 券	2021082600015 441	光 弘 科 技	2021-08- 26	143,400.00	12,000.00	28	3.30	368.06	-	-
中 信 证 券	2021082600015 443	电 连 技 术	2021-08- 26	1,957,800.0 0	52,000.00	28	3.50	5,329.57	-	-
中 信 证 券	2021083100000 674	长 盈 精 密	2021-08- 31	1,843,560.0 0	108,000.0 0	14	3.40	2,437.60	-	-
中 信 证 券	2021083100012 765	大 富 科 技	2021-08- 31	335,880.00	36,000.00	14	3.50	457.17	-	-
中 信 证 券	2021083100012 767	大 富 科 技	2021-08- 31	258,441.00	27,700.00	14	3.50	351.77	-	-
中 信 证 券	2021083100012 769	大 富 科 技	2021-08- 31	321,885.00	34,500.00	14	3.50	438.12	-	-
中 信 证 券	2021083100012 771	光 弘 科 技	2021-08- 31	1,699,360.0 0	152,000.0 0	14	3.50	2,313.02	-	-
中 信 证 券	2021083100012 773	电 连 技 术	2021-08- 31	2,911,545.0 0	81,900.00	14	3.70	4,189.39	-	-
中 信 证 券	2021083100012 775	中 际 旭 创	2021-08- 31	892,584.00	25,200.00	14	3.90	1,353.75	-	-
中 信 证 券	2021083100012 777	中 际 旭 创	2021-08- 31	2,125,200.0 0	60,000.00	14	3.90	3,223.22	-	-
中 信	2021083100012 781	硕 贝	2021-08- 31	1,872,000.0 0	160,000.0 0	14	3.50	2,548.00	-	-

证 券		德								
中 信 证 券	2021083100012 783	东 方 国 信	2021-08- 31	1,546,820.0 0	158,000.0 0	14	3.70	2,225.70	-	-
中 信 证 券	2021083100012 785	天 孚 通 信	2021-08- 31	262,900.00	10,000.00	14	3.60	368.06	-	-
中 信 证 券	2021083100012 787	新 易 盛	2021-08- 31	1,641,533.0 0	47,900.00	14	3.60	2,298.15	-	-
中 信 证 券	2021083100012 789	天 孚 通 信	2021-08- 31	52,580.00	2,000.00	14	3.60	73.61	-	-
中 信 证 券	2021083100012 791	信 维 通 信	2021-08- 31	270,240.00	12,000.00	14	2.40	252.22	-	-
中 信 证 券	2021090200001 224	光 弘 科 技	2021-09- 02	866,248.00	77,900.00	14	3.60	1,212.75	-	-
中 信 证 券	2021090200010 870	广 和 通	2021-09- 02	2,692,040.0 0	62,000.00	14	3.70	3,873.55	-	-
中 信 证 券	2021090200010 872	新 易 盛	2021-09- 02	1,709,500.0 0	50,000.00	14	3.60	2,393.30	-	-
中 信 证 券	2021090200010 874	圣 邦 股 份	2021-09- 02	3,961,620.0 0	13,000.00	14	3.50	5,392.21	-	-
中 信 证 券	2021090200010 876	硕 贝 德	2021-09- 02	357,000.00	30,000.00	14	3.50	485.92	-	-
中 信 证 券	2021090200010 878	东 方 国	2021-09- 02	687,280.00	71,000.00	14	3.70	988.92	-	-

券		信								
中信 证券	2021090200010 880	天孚 通信	2021-09- 02	238,320.00	9,000.00	14	3.60	333.65	-	-
中信 证券	2021090200010 882	中际 旭创	2021-09- 02	1,856,400.0 0	52,000.00	14	3.90	2,815.54	-	-
中信 证券	2021090200010 886	网宿 科技	2021-09- 02	580,060.00	97,000.00	14	3.50	789.53	-	-
中信 证券	2021090700000 830	电连 技术	2021-09- 07	2,024,541.0 0	44,900.00	14	3.60	3,036.81	-	-
中信 证券	2021090700000 834	广和 通	2021-09- 07	2,060,892.0 0	43,700.00	14	3.50	3,005.46	-	-
中信 证券	2021090700020 697	东方 国信	2021-09- 07	535,665.00	53,300.00	14	3.70	825.81	-	-
中信 证券	2021090700020 699	天孚 通信	2021-09- 07	2,631,200.0 0	92,000.00	14	3.70	4,056.43	-	-
中信 证券	2021090700020 701	天孚 通信	2021-09- 07	829,400.00	29,000.00	14	3.70	1,278.65	-	-
中信 证券	2021090900014 137	信维 通信	2021-09- 09	1,678,600.0 0	70,000.00	14	2.90	1,893.09	-	-
中信 证券	2021090900014 139	中际 旭创	2021-09- 09	2,128,800.0 0	60,000.00	14	3.80	3,145.89	-	-
中信 证券	2021090900014 141	硕贝 德	2021-09- 09	1,377,000.0 0	100,000.0 0	14	3.50	1,874.25	-	-

中信证券	2021090900014143	圣邦股份	2021-09-09	2,471,840.00	8,000.00	14	3.40	3,268.32	-	-
中信证券	2021090900014145	圣邦股份	2021-09-09	1,853,880.00	6,000.00	14	3.40	2,451.24	-	-
中信证券	2021090900014147	电连技术	2021-09-09	2,257,000.00	50,000.00	14	3.80	3,335.34	-	-
中信证券	2021090900014149	网宿科技	2021-09-09	1,167,450.00	181,000.00	14	3.50	1,589.03	-	-
中信证券	2021090900014151	网宿科技	2021-09-09	3,889,350.00	603,000.00	14	3.50	5,293.84	-	-
中信证券	2021090900014173	天孚通信	2021-09-09	468,640.00	16,000.00	14	3.70	674.32	-	-
中信证券	2021090900014175	新易盛	2021-09-09	2,330,200.00	61,000.00	14	3.70	3,352.90	-	-
中信证券	2021090900014177	新易盛	2021-09-09	534,800.00	14,000.00	14	3.70	769.52	-	-
中信证券	2021091400000950	新易盛	2021-09-14	1,951,600.00	56,000.00	14	3.90	2,959.93	-	-
中信证券	2021091400015762	天孚通信	2021-09-14	55,100.00	2,000.00	14	3.80	81.43	-	-
中信证券	2021091400015764	硕贝德	2021-09-14	2,000,000.00	160,000.00	14	3.50	2,722.22	-	-
中	2021091400015	电	2021-09-	3,738,735.0	81,900.00	14	3.60	5,234.23	-	-

信 证 券	766	连 技 术	14	0						
中 信 证 券	2021091400015 768	光 弘 科 技	2021-09- 14	1,991,200.0 0	152,000.0 0	14	3.70	2,865.12	-	-
中 信 证 券	2021091400015 770	中 际 旭 创	2021-09- 14	864,864.00	25,200.00	14	2.80	941.74	-	-
中 信 证 券	2021091400015 772	大 富 科 技	2021-09- 14	280,324.00	27,700.00	14	3.50	381.55	-	-
中 信 证 券	2021091400015 774	新 易 盛	2021-09- 14	1,669,315.0 0	47,900.00	14	4.00	2,596.71	-	-
中 信 证 券	2021091400015 776	东 方 国 信	2021-09- 14	1,594,220.0 0	158,000.0 0	14	3.60	2,231.91	-	-
中 信 证 券	2021091400015 780	中 际 旭 创	2021-09- 14	2,059,200.0 0	60,000.00	14	2.80	2,242.24	-	-
中 信 证 券	2021091400015 782	信 维 通 信	2021-09- 14	284,160.00	12,000.00	14	3.10	342.57	-	-
中 信 证 券	2021091400015 784	长 盈 精 密	2021-09- 14	1,827,360.0 0	108,000.0 0	14	3.20	2,274.05	-	-
中 信 证 券	2021091400015 786	天 孚 通 信	2021-09- 14	275,500.00	10,000.00	14	3.80	407.13	-	-
中 信 证 券	2021091400015 788	大 富 科 技	2021-09- 14	364,320.00	36,000.00	14	3.50	495.88	-	-
中 信	2021091400015 790	大 富	2021-09- 14	349,140.00	34,500.00	14	3.50	475.22	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021091600000 931	中 际 旭 创	2021-09- 16	34,320.00	1,000.00	14	3.80	50.72	-	-
中 信 证 券	2021091600012 789	电 连 技 术	2021-09- 16	2,188,553.0 0	50,300.00	28	3.50	5,957.73	-	-
中 信 证 券	2021091600012 791	圣 邦 股 份	2021-09- 16	3,974,620.0 0	13,000.00	14	2.70	4,173.35	-	-
中 信 证 券	2021091600012 793	光 弘 科 技	2021-09- 16	131,000.00	10,000.00	28	3.60	366.80	-	-
中 信 证 券	2021091600012 795	光 弘 科 技	2021-09- 16	209,600.00	16,000.00	28	3.60	586.88	-	-
中 信 证 券	2021091600012 797	新 易 盛	2021-09- 16	1,037,000.0 0	30,500.00	28	3.90	3,145.57	-	-
中 信 证 券	2021091600012 799	天 孚 通 信	2021-09- 16	237,600.00	9,000.00	14	3.80	351.12	-	-
中 信 证 券	2021091600012 801	广 和 通	2021-09- 16	2,632,520.0 0	62,000.00	14	3.50	3,583.15	-	-
中 信 证 券	2021091600012 803	新 易 盛	2021-09- 16	1,700,000.0 0	50,000.00	14	4.00	2,644.44	-	-
中 信 证 券	2021091600012 807	光 弘 科 技	2021-09- 16	1,020,490.0 0	77,900.00	14	3.70	1,468.37	-	-
中 信 证 券	2021091600012 809	光 弘 科 技	2021-09- 16	131,000.00	10,000.00	28	3.60	366.80	-	-

券		技								
中信证券	2021091600012811	光环新网	2021-09-16	1,884,840.00	139,000.00	28	2.00	2,931.97	-	-
中信证券	2021091600012813	中际旭创	2021-09-16	3,432,000.00	100,000.00	28	2.70	7,207.20	-	-
中信证券	2021091600012815	硕贝德	2021-09-16	358,800.00	30,000.00	14	3.50	488.37	-	-
中信证券	2021091600012817	东方国信	2021-09-16	690,830.00	71,000.00	14	3.60	967.16	-	-
中信证券	2021091600012819	中际旭创	2021-09-16	1,784,640.00	52,000.00	14	2.80	1,943.27	-	-
中信证券	2021091600012821	网宿科技	2021-09-16	623,710.00	97,000.00	14	2.00	485.11	-	-
中信证券	2021091600012823	大富科技	2021-09-16	3,305,970.00	337,000.00	28	3.40	8,742.45	-	-
中信证券	2021091600012825	大富科技	2021-09-16	555,246.00	56,600.00	28	3.40	1,468.32	-	-
中信证券	2021092200037173	大富科技	2021-09-22	1,606,080.00	168,000.00	28	3.60	4,497.02	-	-
中信证券	2021092200037175	网宿科技	2021-09-22	3,120,000.00	500,000.00	28	3.50	8,493.33	-	-
中信证券	2021092200037263	网宿科技	2021-09-22	1,553,760.00	249,000.00	28	3.50	4,229.68	-	-

中信证券	2021092200037265	东方国信	2021-09-22	503,152.00	53,300.00	14	4.30	961.58	-	-
中信证券	2021092200037267	天孚通信	2021-09-22	2,403,960.00	92,000.00	14	3.80	4,060.02	-	-
中信证券	2021092200037269	中科创达	2021-09-22	1,174,400.00	10,000.00	28	2.30	2,100.87	-	-
中信证券	2021092200037271	东方国信	2021-09-22	1,538,720.00	163,000.00	28	4.20	5,026.49	-	-
中信证券	2021092200037273	天孚通信	2021-09-22	757,770.00	29,000.00	14	3.80	1,279.79	-	-
中信证券	2021092200037275	新易盛	2021-09-22	1,506,960.00	46,000.00	28	3.80	4,453.90	-	-
中信证券	2021092200037279	广和通	2021-09-22	1,802,625.00	43,700.00	14	3.60	2,884.21	-	-
中信证券	2021092200037281	广和通	2021-09-22	1,443,750.00	35,000.00	28	3.50	3,930.21	-	-
中信证券	2021092200037283	圣邦股份	2021-09-22	3,139,500.00	10,000.00	28	3.20	7,813.87	-	-
中信证券	2021092200037285	广和通	2021-09-22	412,500.00	10,000.00	28	3.50	1,122.92	-	-
中信证券	2021092200037287	电连技术	2021-09-22	1,914,985.00	44,900.00	14	3.70	3,149.09	-	-
中	2021092300001	中	2021-09-	1,231,920.0	36,000.00	14	5.40	2,771.82	-	-

信 证 券	082	际 旭 创	23	0						
中 信 证 券	2021092300013 555	光 弘 科 技	2021-09- 23	123,360.00	9,600.00	28	3.40	326.22	-	-
中 信 证 券	2021092300013 557	光 弘 科 技	2021-09- 23	154,200.00	12,000.00	28	3.40	407.77	-	-
中 信 证 券	2021092300013 559	电 连 技 术	2021-09- 23	2,163,200.0 0	52,000.00	28	3.60	6,056.96	-	-
中 信 证 券	2021092300013 561	电 连 技 术	2021-09- 23	2,080,000.0 0	50,000.00	14	3.70	3,206.67	-	-
中 信 证 券	2021092300013 563	光 弘 科 技	2021-09- 23	539,700.00	42,000.00	28	3.40	1,427.21	-	-
中 信 证 券	2021092300013 565	圣 邦 股 份	2021-09- 23	2,568,000.0 0	8,000.00	14	3.30	3,531.00	-	-
中 信 证 券	2021092300013 567	信 维 通 信	2021-09- 23	1,710,100.0 0	70,000.00	14	3.30	2,351.39	-	-
中 信 证 券	2021092300013 569	东 方 国 信	2021-09- 23	1,101,685.0 0	110,500.0 0	28	4.20	3,598.84	-	-
中 信 证 券	2021092300013 571	大 富 科 技	2021-09- 23	609,579.00	63,300.00	28	3.60	1,706.82	-	-
中 信 证 券	2021092300013 573	东 方 国 信	2021-09- 23	997,000.00	100,000.0 0	28	4.20	3,256.87	-	-
中 信	2021092300013 575	网 宿	2021-09- 23	3,798,900.0 0	603,000.0 0	14	3.60	5,698.35	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021092300013 577	中 际 旭 创	2021-09- 23	2,053,200.0 0	60,000.00	14	3.80	3,250.90	-	-
中 信 证 券	2021092300013 579	新 易 盛	2021-09- 23	1,232,100.0 0	37,000.00	28	3.80	3,641.54	-	-
中 信 证 券	2021092300013 581	新 易 盛	2021-09- 23	2,031,300.0 0	61,000.00	14	3.90	3,300.87	-	-
中 信 证 券	2021092300013 583	圣 邦 股 份	2021-09- 23	13,353,600. 00	41,600.00	28	3.20	33,235.63	-	-
中 信 证 券	2021092300013 585	天 孚 通 信	2021-09- 23	433,280.00	16,000.00	14	3.80	686.03	-	-
中 信 证 券	2021092300013 587	硕 贝 德	2021-09- 23	1,210,000.0 0	100,000.0 0	14	3.70	1,865.42	-	-
中 信 证 券	2021092300013 589	光 环 新 网	2021-09- 23	169,125.00	12,500.00	28	3.40	447.24	-	-
中 信 证 券	2021092300013 591	天 孚 通 信	2021-09- 23	54,160.00	2,000.00	28	3.70	155.86	-	-
中 信 证 券	2021092800000 764	中 际 旭 创	2021-09- 28	4,270,000.0 0	125,000.0 0	14	6.00	9,963.33	-	-
中 信 证 券	2021092800012 654	信 维 通 信	2021-09- 28	276,960.00	12,000.00	14	3.30	355.43	-	-
中 信 证 券	2021092800012 656	新 易 盛	2021-09- 28	1,621,415.0 0	47,900.00	14	3.90	2,459.15	-	-

券										
中信 证券	2021092800012 658	新 易 盛	2021-09- 28	1,895,600.0 0	56,000.00	14	3.90	2,874.99	-	-
中信 证券	2021092800012 660	电 连 技 术	2021-09- 28	3,285,009.0 0	81,900.00	14	3.70	4,726.76	-	-
中信 证券	2021092800012 662	光 弘 科 技	2021-09- 28	1,931,920.0 0	152,000.0 0	14	3.50	2,629.56	-	-
中信 证券	2021092800012 664	硕 贝 德	2021-09- 28	1,816,000.0 0	160,000.0 0	14	3.70	2,613.02	-	-
中信 证券	2021092800012 666	大 富 科 技	2021-09- 28	259,549.00	27,700.00	14	3.70	373.46	-	-
中信 证券	2021092800012 668	中 际 旭 创	2021-09- 28	2,049,600.0 0	60,000.00	14	3.80	3,028.85	-	-
中信 证券	2021092800012 670	天 孚 通 信	2021-09- 28	254,500.00	10,000.00	14	3.80	376.09	-	-
中信 证券	2021092800012 672	中 际 旭 创	2021-09- 28	860,832.00	25,200.00	14	3.80	1,272.12	-	-
中信 证券	2021092800012 674	天 孚 通 信	2021-09- 28	50,900.00	2,000.00	14	3.80	75.22	-	-
中信 证券	2021092800012 676	东 方 国 信	2021-09- 28	1,466,240.0 0	158,000.0 0	14	4.30	2,451.88	-	-
中信 证券	2021092800014 050	大 富 科 技	2021-09- 28	323,265.00	34,500.00	14	3.70	465.14	-	-

中信证券	2021092800014052	大富科技	2021-09-28	337,320.00	36,000.00	14	3.70	485.37	-	-
中信证券	2021093000000318	信维通信	2021-09-30	2,186,380.00	97,000.00	14	3.00	2,550.78	-	-
中信证券	2021093000000320	新易盛	2021-09-30	1,919,190.00	57,000.00	14	3.90	2,910.77	-	-
中信证券	2021093000000324	光环新网	2021-09-30	1,866,150.00	145,000.00	14	3.40	2,467.47	-	-
中信证券	20210930000010949	新易盛	2021-09-30	1,683,500.00	50,000.00	14	3.90	2,553.31	-	-
中信证券	20210930000010951	中际旭创	2021-09-30	1,813,760.00	52,000.00	14	5.40	3,808.90	-	-
中信证券	20210930000010953	光弘科技	2021-09-30	1,021,269.00	77,900.00	14	3.30	1,310.63	-	-
中信证券	20210930000010955	中际旭创	2021-09-30	34,880.00	1,000.00	14	5.40	73.25	-	-
中信证券	20210930000010957	硕贝德	2021-09-30	327,900.00	30,000.00	14	3.50	446.31	-	-
中信证券	20210930000010959	东方国信	2021-09-30	647,520.00	71,000.00	14	3.30	830.98	-	-
中信证券	20210930000010961	天孚通信	2021-09-30	220,770.00	9,000.00	14	3.50	300.49	-	-
中	20210930000010	网	2021-09-	558,720.00	97,000.00	14	3.30	717.02	-	-

信 证 券	965	宿 科 技	30							
中 信 证 券	2021093000010 967	圣 邦 股 份	2021-09- 30	4,325,490.0 0	13,000.00	14	3.00	5,046.41	-	-
中 信 证 券	2021100800059 231	广 和 通	2021-10- 08	1,911,875.0 0	43,700.00	14	3.80	2,825.33	-	-
中 信 证 券	2021100800059 233	天 孚 通 信	2021-10- 08	729,640.00	29,000.00	14	3.50	993.12	-	-
中 信 证 券	2021100800059 235	东 方 国 信	2021-10- 08	494,091.00	53,300.00	14	3.30	634.08	-	-
中 信 证 券	2021100800059 237	天 孚 通 信	2021-10- 08	2,314,720.0 0	92,000.00	14	3.50	3,150.59	-	-
中 信 证 券	2021100800071 375	电 连 技 术	2021-10- 08	2,116,000.0 0	50,000.00	14	3.50	2,880.11	-	-
中 信 证 券	2021100800071 377	中 际 旭 创	2021-10- 08	2,103,600.0 0	60,000.00	14	6.00	4,908.40	-	-
中 信 证 券	2021100800071 379	中 际 旭 创	2021-10- 08	1,262,160.0 0	36,000.00	14	6.00	2,945.04	-	-
中 信 证 券	2021100800071 381	信 维 通 信	2021-10- 08	1,627,500.0 0	70,000.00	14	3.00	1,898.75	-	-
中 信 证 券	2021100800071 383	新 易 盛	2021-10- 08	2,099,010.0 0	61,000.00	14	3.90	3,183.50	-	-
中 信	2021100800071 385	网 宿	2021-10- 08	3,575,790.0 0	603,000.0 0	14	3.50	4,867.05	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021100800071 389	天 孚 通 信	2021-10- 08	402,560.00	16,000.00	14	3.60	563.58	-	-
中 信 证 券	2021100800071 397	圣 邦 股 份	2021-10- 08	2,573,440.0 0	8,000.00	14	1.90	1,901.49	-	-
中 信 证 券	2021100800072 451	硕 贝 德	2021-10- 08	1,117,000.0 0	100,000.0 0	14	3.60	1,563.80	-	-
中 信 证 券	2021101200001 226	光 环 新 网	2021-10- 12	1,277,760.0 0	96,000.00	14	3.40	1,689.48	-	-
中 信 证 券	2021101200017 019	中 际 旭 创	2021-10- 12	876,456.00	25,200.00	14	6.00	2,045.06	-	-
中 信 证 券	2021101200017 021	中 际 旭 创	2021-10- 12	2,086,800.0 0	60,000.00	14	6.00	4,869.20	-	-
中 信 证 券	2021101200017 023	中 际 旭 创	2021-10- 12	4,347,500.0 0	125,000.0 0	14	6.00	10,144.17	-	-
中 信 证 券	2021101200017 025	大 富 科 技	2021-10- 12	263,427.00	27,700.00	14	3.60	368.80	-	-
中 信 证 券	2021101200017 027	信 维 通 信	2021-10- 12	277,320.00	12,000.00	14	3.00	323.54	-	-
中 信 证 券	2021101200017 029	东 方 国 信	2021-10- 12	1,442,540.0 0	158,000.0 0	14	3.30	1,851.26	-	-
中 信 证 券	2021101200017 031	新 易 盛	2021-10- 12	1,684,643.0 0	47,900.00	14	3.90	2,555.04	-	-

券										
中信证券	2021101200017035	光弘科技	2021-10-12	1,944,080.00	152,000.00	14	3.60	2,721.71	-	-
中信证券	2021101200017037	新易盛	2021-10-12	1,969,520.00	56,000.00	14	3.90	2,987.11	-	-
中信证券	2021101200017039	硕贝德	2021-10-12	1,777,600.00	160,000.00	14	3.60	2,488.64	-	-
中信证券	2021101200017041	天孚通信	2021-10-12	50,200.00	2,000.00	14	3.60	70.28	-	-
中信证券	2021101200017043	天孚通信	2021-10-12	251,000.00	10,000.00	14	3.60	351.40	-	-
中信证券	2021101200017047	大富科技	2021-10-12	328,095.00	34,500.00	14	3.60	459.33	-	-
中信证券	2021101400000833	网宿科技	2021-10-14	1,058,850.00	181,000.00	14	3.50	1,441.21	-	-
中信证券	2021101400000843	电连技术	2021-10-14	3,004,188.00	72,600.00	14	3.50	4,089.03	-	-
中信证券	2021101400011898	大富科技	2021-10-14	3,204,870.00	337,000.00	28	3.40	8,475.10	-	-
中信证券	2021101400011900	大富科技	2021-10-14	538,266.00	56,600.00	28	3.40	1,423.41	-	-
中信证券	2021101400011902	网宿科技	2021-10-14	567,450.00	97,000.00	14	3.50	772.36	-	-

中信证券	2021101400011904	新易盛	2021-10-14	1,064,450.00	30,500.00	28	3.60	2,980.46	-	-
中信证券	2021101400011906	圣邦股份	2021-10-14	4,233,970.00	13,000.00	14	3.50	5,762.90	-	-
中信证券	2021101400011908	新易盛	2021-10-14	1,989,300.00	57,000.00	14	3.70	2,862.38	-	-
中信证券	2021101400011910	光弘科技	2021-10-14	133,600.00	10,000.00	28	3.50	363.69	-	-
中信证券	2021101400011912	光弘科技	2021-10-14	1,040,744.00	77,900.00	14	3.60	1,457.04	-	-
中信证券	2021101400011914	新易盛	2021-10-14	1,745,000.00	50,000.00	14	3.70	2,510.86	-	-
中信证券	2021101400011916	中际旭创	2021-10-14	34,870.00	1,000.00	14	4.10	55.60	-	-
中信证券	2021101400011918	电连技术	2021-10-14	2,081,414.00	50,300.00	28	3.40	5,504.18	-	-
中信证券	2021101400011920	东方国信	2021-10-14	655,330.00	71,000.00	14	4.20	1,070.37	-	-
中信证券	2021101400011922	天孚通信	2021-10-14	228,780.00	9,000.00	14	3.60	320.29	-	-
中信证券	2021101400011924	信维通信	2021-10-14	2,189,290.00	97,000.00	14	3.40	2,894.73	-	-
中	2021101400011	硕	2021-10-	337,500.00	30,000.00	14	3.70	485.63	-	-

信 证 券	926	贝 德	14							
中 信 证 券	2021101400011 928	中 际 旭 创	2021-10- 14	1,813,240.0 0	52,000.00	14	4.10	2,891.11	-	-
中 信 证 券	2021101400011 930	中 际 旭 创	2021-10- 14	3,487,000.0 0	100,000.0 0	28	4.00	10,848.44	-	-
中 信 证 券	2021101400011 932	光 环 新 网	2021-10- 14	1,944,450.0 0	145,000.0 0	14	3.40	2,571.00	-	-
中 信 证 券	2021101400013 336	光 弘 科 技	2021-10- 14	213,760.00	16,000.00	28	3.50	581.90	-	-
中 信 证 券	2021101400013 338	光 弘 科 技	2021-10- 14	133,600.00	10,000.00	28	3.50	363.69	-	-
中 信 证 券	2021102000005 369	网 宿 科 技	2021-10- 20	2,875,000.0 0	500,000.0 0	28	3.40	7,602.78	-	-
中 信 证 券	2021102000005 371	新 易 盛	2021-10- 20	1,446,700.0 0	46,000.00	28	3.60	4,050.76	-	-
中 信 证 券	2021102000005 373	中 科 创 达	2021-10- 20	1,231,000.0 0	10,000.00	28	2.60	2,489.36	-	-
中 信 证 券	2021102000005 375	广 和 通	2021-10- 20	499,800.00	10,000.00	28	3.50	1,360.57	-	-
中 信 证 券	2021102000005 377	广 和 通	2021-10- 20	1,749,300.0 0	35,000.00	28	3.50	4,761.98	-	-
中 信	2021102000005 379	圣 邦	2021-10- 20	3,202,100.0 0	10,000.00	28	3.40	8,467.78	-	-

证 券		股 份								
中 信 证 券	2021102000005 381	网 宿 科 技	2021-10- 20	1,431,750.0 0	249,000.0 0	28	3.40	3,786.18	-	-
中 信 证 券	2021102100000 790	网 宿 科 技	2021-10- 21	33,540.00	6,000.00	14	3.50	45.65	-	-
中 信 证 券	2021102100000 794	光 环 新 网	2021-10- 21	26,280.00	2,000.00	14	3.50	35.77	-	-
中 信 证 券	2021102100000 795	电 连 技 术	2021-10- 21	2,791,530.0 0	63,000.00	14	3.60	3,908.14	-	-
中 信 证 券	2021102100000 800	网 宿 科 技	2021-10- 21	150,930.00	27,000.00	28	3.40	399.13	-	-
中 信 证 券	2021102100000 802	光 弘 科 技	2021-10- 21	698,264.00	51,800.00	14	3.70	1,004.72	-	-
中 信 证 券	2021102100000 805	广 和 通	2021-10- 21	1,213,250.0 0	25,000.00	14	3.80	1,792.91	-	-
中 信 证 券	2021102100004 772	光 弘 科 技	2021-10- 21	161,760.00	12,000.00	28	3.50	440.35	-	-
中 信 证 券	2021102100004 776	光 弘 科 技	2021-10- 21	129,408.00	9,600.00	28	3.50	352.28	-	-
中 信 证 券	2021102100004 780	电 连 技 术	2021-10- 21	2,304,120.0 0	52,000.00	28	3.40	6,093.12	-	-
中 信 证 券	2021102100004 782	新 易 盛	2021-10- 21	1,143,300.0 0	37,000.00	28	3.60	3,201.24	-	-

券										
中信 证券	2021102100004 784	东方 国信	2021-10- 21	910,000.00	100,000.0 0	28	4.10	2,901.89	-	-
中信 证券	2021102100004 786	东方 国信	2021-10- 21	1,005,550.0 0	110,500.0 0	28	4.10	3,206.59	-	-
中信 证券	2021102200053 748	中际 旭创	2021-10- 22	1,969,200.0 0	60,000.00	14	4.10	3,139.78	-	-
中信 证券	2021102200053 750	东方 国信	2021-10- 22	482,898.00	53,300.00	14	4.20	788.73	-	-
中信 证券	2021102200053 752	信维 通信	2021-10- 22	1,495,200.0 0	70,000.00	14	3.40	1,976.99	-	-
中信 证券	2021102200053 754	新易 盛	2021-10- 22	1,825,730.0 0	61,000.00	14	3.70	2,627.02	-	-
中信 证券	2021102200053 756	中际 旭创	2021-10- 22	1,181,520.0 0	36,000.00	14	4.10	1,883.87	-	-
中信 证券	2021102200053 758	广和 通	2021-10- 22	2,059,581.0 0	43,700.00	14	3.60	2,883.41	-	-
中信 证券	2021102200053 760	天孚 通信	2021-10- 22	709,630.00	29,000.00	14	3.60	993.48	-	-
中信 证券	2021102200053 762	硕贝 德	2021-10- 22	1,057,000.0 0	100,000.0 0	14	3.70	1,520.91	-	-
中信 证券	2021102200053 764	天孚 通信	2021-10- 22	2,251,240.0 0	92,000.00	14	3.60	3,151.74	-	-

中信证券	2021102200053866	天孚通信	2021-10-22	391,520.00	16,000.00	14	3.60	548.13	-	-
中信证券	2021102200053870	网宿科技	2021-10-22	3,364,740.00	603,000.00	14	3.50	4,579.79	-	-
中信证券	2021102200053872	电连技术	2021-10-22	2,160,500.00	50,000.00	14	3.50	2,940.68	-	-
中信证券	2021102200056930	圣邦股份	2021-10-22	2,568,000.00	8,000.00	14	3.50	3,495.33	-	-
中信证券	2021102600001301	光环新网	2021-10-26	1,335,000.00	100,000.00	14	3.40	1,765.17	-	-
中信证券	2021102600001302	大富科技	2021-10-26	1,122,180.00	118,000.00	14	3.80	1,658.33	-	-
中信证券	2021102600014304	新易盛	2021-10-26	1,489,690.00	47,900.00	14	3.50	2,027.63	-	-
中信证券	2021102600014306	新易盛	2021-10-26	1,741,600.00	56,000.00	14	3.50	2,370.51	-	-
中信证券	2021102600014308	天孚通信	2021-10-26	53,980.00	2,000.00	14	3.70	77.67	-	-
中信证券	2021102600014310	硕贝德	2021-10-26	1,760,000.00	160,000.00	14	3.80	2,600.89	-	-
中信证券	2021102600014312	信维通信	2021-10-26	297,120.00	12,000.00	14	3.50	404.41	-	-
中	2021102600014	中	2021-10-	4,288,750.0	125,000.0	14	5.10	8,506.02	-	-

信 证 券	314	际 旭 创	26	0	0					
中 信 证 券	2021102600014 316	中 际 旭 创	2021-10- 26	2,058,600.0 0	60,000.00	14	5.10	4,082.89	-	-
中 信 证 券	2021102600014 318	光 弘 科 技	2021-10- 26	2,173,600.0 0	152,000.0 0	14	3.70	3,127.57	-	-
中 信 证 券	2021102600014 320	大 富 科 技	2021-10- 26	263,427.00	27,700.00	14	3.70	379.04	-	-
中 信 证 券	2021102600014 322	东 方 国 信	2021-10- 26	1,396,720.0 0	158,000.0 0	14	3.50	1,901.09	-	-
中 信 证 券	2021102800001 187	长 盈 精 密	2021-10- 28	204,750.00	15,000.00	14	3.60	286.65	-	-
中 信 证 券	2021102800012 785	光 环 新 网	2021-10- 28	1,867,600.0 0	145,000.0 0	14	3.50	2,542.01	-	-
中 信 证 券	2021102800012 787	网 宿 科 技	2021-10- 28	939,390.00	181,000.0 0	14	3.50	1,278.61	-	-
中 信 证 券	2021102800012 789	电 连 技 术	2021-10- 28	3,024,516.0 0	72,600.00	14	3.60	4,234.32	-	-
中 信 证 券	2021102800012 791	圣 邦 股 份	2021-10- 28	4,089,800.0 0	13,000.00	14	3.50	5,566.67	-	-
中 信 证 券	2021102800012 793	中 际 旭 创	2021-10- 28	1,706,120.0 0	52,000.00	14	5.10	3,383.80	-	-
中 信	2021102800012 795	东 方	2021-10- 28	607,760.00	71,000.00	14	3.50	827.23	-	-

证 券		国 信								
中 信 证 券	2021102800012 797	中 际 旭 创	2021-10- 28	32,810.00	1,000.00	14	5.10	65.07	-	-
中 信 证 券	2021102800012 799	天 孚 通 信	2021-10- 28	226,800.00	9,000.00	14	3.70	326.34	-	-
中 信 证 券	2021102800012 801	光 弘 科 技	2021-10- 28	1,065,672.0 0	77,900.00	14	3.70	1,533.38	-	-
中 信 证 券	2021102800013 221	新 易 盛	2021-10- 28	1,409,000.0 0	50,000.00	14	3.50	1,917.81	-	-
中 信 证 券	2021102800013 223	硕 贝 德	2021-10- 28	306,900.00	30,000.00	14	3.80	453.53	-	-
中 信 证 券	2021102800013 225	网 宿 科 技	2021-10- 28	503,430.00	97,000.00	14	3.50	685.22	-	-
中 信 证 券	2021102800013 227	新 易 盛	2021-10- 28	1,606,260.0 0	57,000.00	14	3.50	2,186.30	-	-
中 信 证 券	2021102800013 229	信 维 通 信	2021-10- 28	2,287,260.0 0	97,000.00	14	3.50	3,113.22	-	-
中 信 证 券	2021110200000 609	网 宿 科 技	2021-11- 02	3,856,350.0 0	705,000.0 0	14	3.50	5,248.92	-	-
中 信 证 券	2021110200000 618	蓝 思 科 技	2021-11- 02	442,600.00	20,000.00	14	2.10	361.46	-	-
中 信 证 券	2021110400000 734	网 宿 科 技	2021-11- 04	4,348,900.0 0	785,000.0 0	14	3.50	5,919.34	-	-

券		技								
中信 证券	2021110400000 739	信 维 通 信	2021-11- 04	2,158,072.0 0	86,600.00	14	3.40	2,853.45	-	-
中信 证券	2021110400000 746	天 孚 通 信	2021-11- 04	3,003,750.0 0	112,500.0 0	14	3.80	4,438.88	-	-
中信 证券	2021110400000 756	蓝 思 科 技	2021-11- 04	327,000.00	15,000.00	14	2.10	267.05	-	-
中信 证券	2021110400000 757	新 易 盛	2021-11- 04	591,400.00	20,000.00	14	3.30	758.96	-	-
中信 证券	2021110400000 764	电 连 技 术	2021-11- 04	3,003,900.0 0	62,000.00	14	3.60	4,205.46	-	-
中信 证券	2021110400000 767	卓 胜 微	2021-11- 04	3,123,500.0 0	10,000.00	14	3.70	4,494.37	-	-
中信 证券	2021110400003 589	广 和 通	2021-11- 04	1,248,000.0 0	25,000.00	14	3.80	1,844.27	-	-
中信 证券	2021110400003 591	网 宿 科 技	2021-11- 04	33,240.00	6,000.00	14	3.10	40.07	-	-
中信 证券	2021110400003 593	光 环 新 网	2021-11- 04	27,420.00	2,000.00	14	3.40	36.26	-	-
中信 证券	2021110400003 595	电 连 技 术	2021-11- 04	3,052,350.0 0	63,000.00	14	3.60	4,273.29	-	-
中信 证券	2021110400003 599	光 弘 科 技	2021-11- 04	797,720.00	51,800.00	14	3.80	1,178.85	-	-

中信证券	2021110500064907	电连技术	2021-11-05	2,521,500.00	50,000.00	14	3.60	3,530.10	-	-
中信证券	2021110500064909	广和通	2021-11-05	2,213,842.00	43,700.00	14	3.80	3,271.57	-	-
中信证券	2021110500064911	天孚通信	2021-11-05	428,320.00	16,000.00	14	3.80	632.96	-	-
中信证券	2021110500064913	硕贝德	2021-11-05	1,124,000.00	100,000.00	14	3.80	1,661.02	-	-
中信证券	2021110500064915	天孚通信	2021-11-05	776,330.00	29,000.00	14	3.80	1,147.24	-	-
中信证券	2021110500064917	天孚通信	2021-11-05	2,462,840.00	92,000.00	14	3.80	3,639.53	-	-
中信证券	2021110500064919	东方国信	2021-11-05	499,421.00	53,300.00	14	3.60	699.19	-	-
中信证券	2021110500065615	网宿科技	2021-11-05	3,431,070.00	603,000.00	14	3.10	4,136.35	-	-
中信证券	2021110500065617	信维通信	2021-11-05	1,771,000.00	70,000.00	14	3.30	2,272.78	-	-
中信证券	2021110900017600	新易盛	2021-11-09	1,662,640.00	56,000.00	14	3.30	2,133.72	-	-
中信证券	2021110900017602	信维通信	2021-11-09	298,320.00	12,000.00	14	3.40	394.45	-	-
中	2021110900017	新	2021-11-	1,422,151.0	47,900.00	14	3.30	1,825.09	-	-

信 证 券	604	易 盛	09	0						
中 信 证 券	2021110900017 606	天 孚 通 信	2021-11- 09	54,900.00	2,000.00	14	3.80	81.13	-	-
中 信 证 券	2021110900017 608	硕 贝 德	2021-11- 09	1,833,600.0 0	160,000.0 0	14	3.30	2,353.12	-	-
中 信 证 券	2021110900017 612	光 弘 科 技	2021-11- 09	2,270,880.0 0	152,000.0 0	14	3.90	3,444.17	-	-
中 信 证 券	2021110900017 614	大 富 科 技	2021-11- 09	1,239,000.0 0	118,000.0 0	14	3.70	1,782.78	-	-
中 信 证 券	2021110900017 616	东 方 国 信	2021-11- 09	1,499,420.0 0	158,000.0 0	14	3.60	2,099.19	-	-
中 信 证 券	2021110900017 618	光 环 新 网	2021-11- 09	1,419,000.0 0	100,000.0 0	14	3.50	1,931.42	-	-
中 信 证 券	2021110900017 620	中 际 旭 创	2021-11- 09	4,361,250.0 0	125,000.0 0	14	4.30	7,292.98	-	-
中 信 证 券	2021110900017 622	中 际 旭 创	2021-11- 09	2,093,400.0 0	60,000.00	14	4.30	3,500.63	-	-
中 信 证 券	2021111100010 570	新 易 盛	2021-11- 11	1,749,330.0 0	57,000.00	14	3.30	2,244.97	-	-
中 信 证 券	2021111100010 572	光 弘 科 技	2021-11- 11	1,158,373.0 0	77,900.00	14	3.90	1,756.87	-	-
中 信	2021111100010 574	中 际	2021-11- 11	1,838,720.0 0	52,000.00	14	4.30	3,074.75	-	-

证 券		旭 创								
中 信 证 券	2021111100010 576	光 环 新 网	2021-11- 11	2,034,350.0 0	145,000.0 0	14	3.50	2,768.98	-	-
中 信 证 券	2021111100010 578	网 宿 科 技	2021-11- 11	1,073,330.0 0	181,000.0 0	14	3.50	1,460.92	-	-
中 信 证 券	2021111100010 580	天 孚 通 信	2021-11- 11	249,570.00	9,000.00	14	3.80	368.81	-	-
中 信 证 券	2021111100010 582	光 弘 科 技	2021-11- 11	148,700.00	10,000.00	28	3.80	439.49	-	-
中 信 证 券	2021111100010 584	新 易 盛	2021-11- 11	1,534,500.0 0	50,000.00	14	3.30	1,969.28	-	-
中 信 证 券	2021111100010 586	网 宿 科 技	2021-11- 11	575,210.00	97,000.00	14	3.50	782.92	-	-
中 信 证 券	2021111100010 588	长 盈 精 密	2021-11- 11	249,150.00	15,000.00	14	3.60	348.81	-	-
中 信 证 券	2021111100010 590	电 连 技 术	2021-11- 11	3,811,500.0 0	72,600.00	14	3.60	5,336.10	-	-
中 信 证 券	2021111100012 712	硕 贝 德	2021-11- 11	372,000.00	30,000.00	14	3.30	477.40	-	-
中 信 证 券	2021111100012 714	新 易 盛	2021-11- 11	936,045.00	30,500.00	28	3.20	2,329.71	-	-
中 信 证 券	2021111100012 716	中 际 旭	2021-11- 11	3,536,000.0 0	100,000.0 0	28	4.20	11,550.93	-	-

券		创								
中信 证券	2021111100012 718	东方 国信	2021-11- 11	683,730.00	71,000.00	14	3.60	957.22	-	-
中信 证券	2021111100012 720	信维 通信	2021-11- 11	2,446,340.0 0	97,000.00	14	3.40	3,234.61	-	-
中信 证券	2021111600001 110	电连 技术	2021-11- 16	250,500.00	5,000.00	14	3.80	370.18	-	-
中信 证券	2021111600001 123	信维 通信	2021-11- 16	5,572,565.0 0	213,100.0 0	14	3.40	7,368.17	-	-
中信 证券	2021111600004 776	网宿 科技	2021-11- 16	4,434,450.0 0	705,000.0 0	14	3.60	6,208.23	-	-
中信 证券	2021111700006 105	广和 通	2021-11- 17	1,913,800.0 0	35,000.00	28	3.60	5,358.64	-	-
中信 证券	2021111700006 107	圣邦 股份	2021-11- 17	3,415,000.0 0	10,000.00	28	2.70	7,171.50	-	-
中信 证券	2021111700006 109	网宿 科技	2021-11- 17	1,601,070.0 0	249,000.0 0	28	3.50	4,358.47	-	-
中信 证券	2021111800000 977	大富 科技	2021-11- 18	1,192,000.0 0	100,000.0 0	14	3.70	1,715.16	-	-
中信 证券	2021111800000 980	蓝思 科技	2021-11- 18	289,770.00	13,000.00	14	2.30	259.18	-	-
中信 证券	2021111800005 559	网宿 科技	2021-11- 18	171,990.00	27,000.00	28	3.50	468.20	-	-

中信证券	2021111800005561	电连技术	2021-11-18	3,288,600.00	63,000.00	14	3.70	4,731.93	-	-
中信证券	2021111800005563	新易盛	2021-11-18	603,000.00	20,000.00	14	3.40	797.30	-	-
中信证券	2021111800005565	天孚通信	2021-11-18	3,228,750.00	112,500.00	14	3.90	4,896.94	-	-
中信证券	2021111800005567	光环新网	2021-11-18	29,320.00	2,000.00	14	3.60	41.05	-	-
中信证券	2021111800005569	电连技术	2021-11-18	2,714,400.00	52,000.00	28	3.60	7,600.32	-	-
中信证券	2021111800005571	电连技术	2021-11-18	3,236,400.00	62,000.00	14	3.70	4,656.82	-	-
中信证券	2021111800005573	网宿科技	2021-11-18	5,000,450.00	785,000.00	14	3.60	7,000.63	-	-
中信证券	2021111800005575	信维通信	2021-11-18	2,162,402.00	86,600.00	14	3.40	2,859.18	-	-
中信证券	2021111800005579	卓胜微	2021-11-18	3,038,500.00	10,000.00	14	3.60	4,253.90	-	-
中信证券	2021111800005581	光弘科技	2021-11-18	721,056.00	51,800.00	14	4.00	1,121.64	-	-
中信证券	2021111800005583	光弘科技	2021-11-18	133,632.00	9,600.00	28	3.90	405.35	-	-
中	2021111900038	电	2021-11-	2,742,000.0	50,000.00	14	3.70	3,945.43	-	-

信 证 券	907	连 技 术	19	0						
中 信 证 券	2021111900038 911	硕 贝 德	2021-11- 19	1,280,000.0 0	100,000.0 0	14	3.60	1,792.00	-	-
中 信 证 券	2021111900038 913	东 方 国 信	2021-11- 19	577,772.00	53,300.00	14	3.60	808.88	-	-
中 信 证 券	2021111900038 917	广 和 通	2021-11- 19	2,366,355.0 0	43,700.00	14	3.70	3,404.92	-	-
中 信 证 券	2021111900038 919	天 孚 通 信	2021-11- 19	466,560.00	16,000.00	14	3.90	707.62	-	-
中 信 证 券	2021111900038 925	信 维 通 信	2021-11- 19	1,773,100.0 0	70,000.00	14	3.40	2,344.43	-	-
中 信 证 券	2021111900038 927	网 宿 科 技	2021-11- 19	3,816,990.0 0	603,000.0 0	14	3.60	5,343.79	-	-
中 信 证 券	2021112300000 887	大 富 科 技	2021-11- 23	756,000.00	63,000.00	14	3.70	1,087.80	-	-
中 信 证 券	2021112300000 890	长 盈 精 密	2021-11- 23	237,020.00	14,000.00	14	3.50	322.61	-	-
中 信 证 券	2021112300000 910	中 科 创 达	2021-11- 23	4,586,100.0 0	30,000.00	14	2.90	5,172.10	-	-
中 信 证 券	2021112300012 004	硕 贝 德	2021-11- 23	2,126,400.0 0	160,000.0 0	14	1.90	1,571.17	-	-
中 信	2021112300012 006	大 富	2021-11- 23	1,416,000.0 0	118,000.0 0	14	3.70	2,037.47	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021112300012 008	天 孚 通 信	2021-11- 23	69,380.00	2,000.00	14	3.70	99.83	-	-
中 信 证 券	2021112300012 010	新 易 盛	2021-11- 23	1,895,600.0 0	56,000.00	14	2.70	1,990.38	-	-
中 信 证 券	2021112300012 012	光 弘 科 技	2021-11- 23	2,138,640.0 0	152,000.0 0	14	3.70	3,077.27	-	-
中 信 证 券	2021112300012 014	光 环 新 网	2021-11- 23	1,417,000.0 0	100,000.0 0	14	3.70	2,038.91	-	-
中 信 证 券	2021112300012 016	中 际 旭 创	2021-11- 23	4,861,250.0 0	125,000.0 0	14	2.20	4,159.07	-	-
中 信 证 券	2021112300012 020	信 维 通 信	2021-11- 23	301,440.00	12,000.00	14	3.40	398.57	-	-
中 信 证 券	2021113000004 129	网 宿 科 技	2021-11- 30	4,321,650.0 0	705,000.0 0	14	3.40	5,714.18	-	-
中 信 证 券	2021113000004 137	信 维 通 信	2021-11- 30	5,327,500.0 0	213,100.0 0	14	3.40	7,044.14	-	-
中 信 证 券	2021113000004 139	电 连 技 术	2021-11- 30	276,750.00	5,000.00	14	3.60	387.45	-	-
中 信 证 券	2021120200000 808	长 盈 精 密	2021-12- 02	238,000.00	14,000.00	14	3.50	323.94	-	-
中 信 证 券	2021120200004 299	网 宿 科 技	2021-12- 02	5,369,400.0 0	785,000.0 0	14	3.40	7,099.54	-	-

券		技								
中信 证券	2021120200004 301	信 维 通 信	2021-12- 02	2,159,804.0 0	86,600.00	14	3.40	2,855.74	-	-
中信 证券	2021120200004 303	电 连 技 术	2021-12- 02	3,467,520.0 0	63,000.00	14	3.60	4,854.53	-	-
中信 证券	2021120200004 305	蓝 思 科 技	2021-12- 02	267,410.00	13,000.00	14	2.20	228.78	-	-
中信 证券	2021120200004 307	光 弘 科 技	2021-12- 02	781,662.00	51,800.00	14	3.30	1,003.13	-	-
中信 证券	2021120200004 309	天 孚 通 信	2021-12- 02	3,908,250.0 0	112,500.0 0	14	3.30	5,015.59	-	-
中信 证券	2021120200004 311	电 连 技 术	2021-12- 02	3,412,480.0 0	62,000.00	14	3.60	4,777.47	-	-
中信 证券	2021120200004 313	光 环 新 网	2021-12- 02	29,380.00	2,000.00	14	3.50	39.99	-	-
中信 证券	2021120200004 315	新 易 盛	2021-12- 02	675,000.00	20,000.00	14	3.10	813.75	-	-
中信 证券	2021120300017 235	天 孚 通 信	2021-12- 03	580,000.00	16,000.00	14	3.30	744.33	-	-
中信 证券	2021120300017 237	电 连 技 术	2021-12- 03	2,916,000.0 0	50,000.00	14	3.60	4,082.40	-	-
中信 证券	2021120300017 239	广 和 通	2021-12- 03	2,509,691.0 0	43,700.00	14	4.00	3,903.96	-	-

中信证券	2021120300017241	网宿科技	2021-12-03	4,046,130.00	603,000.00	14	3.40	5,349.88	-	-
中信证券	2021120300017247	东方国信	2021-12-03	547,391.00	53,300.00	14	3.00	638.62	-	-
中信证券	2021120300017249	信维通信	2021-12-03	1,737,400.00	70,000.00	14	3.40	2,297.23	-	-
中信证券	2021120700001080	芒果超媒	2021-12-07	497,090.00	11,000.00	14	3.40	657.26	-	-
中信证券	2021120700001084	中科创达	2021-12-07	288,400.00	2,000.00	14	2.80	314.04	-	-
中信证券	2021120700001085	芒果超媒	2021-12-07	45,190.00	1,000.00	14	3.40	59.75	-	-
中信证券	2021120700001087	长盈精密	2021-12-07	205,800.00	12,000.00	14	3.60	288.12	-	-
中信证券	2021120700008643	光弘科技	2021-12-07	2,229,840.00	152,000.00	14	3.30	2,861.63	-	-
中信证券	2021120700008645	信维通信	2021-12-07	292,800.00	12,000.00	14	3.40	387.15	-	-
中信证券	2021120700008647	新易盛	2021-12-07	1,726,480.00	56,000.00	14	3.10	2,081.37	-	-
中信证券	2021120700008649	中科创达	2021-12-07	4,326,000.00	30,000.00	14	3.40	5,719.93	-	-
中	2021120700008	天	2021-12-	67,260.00	2,000.00	14	3.30	86.32	-	-

信 证 券	651	孚 通 信	07							
中 信 证 券	2021120700008 655	中 际 旭 创	2021-12- 07	4,648,750.0 0	125,000.0 0	14	3.40	6,146.68	-	-
中 信 证 券	2021120700008 657	长 盈 精 密	2021-12- 07	240,100.00	14,000.00	14	3.50	326.80	-	-
中 信 证 券	2021120900000 739	长 盈 精 密	2021-12- 09	231,720.00	12,000.00	14	3.60	324.41	-	-
中 信 证 券	2021120900000 748	中 科 创 达	2021-12- 09	297,000.00	2,000.00	14	2.80	323.40	-	-
中 信 证 券	2021121400001 431	长 盈 精 密	2021-12- 14	2,004,900.0 0	97,800.00	14	3.10	2,417.02	-	-
中 信 证 券	2021121400001 437	信 维 通 信	2021-12- 14	1,324,980.0 0	51,000.00	14	3.30	1,700.39	-	-
中 信 证 券	2021121400001 446	数 码 视 讯	2021-12- 14	2,161,071.0 0	236,700.0 0	14	3.50	2,941.46	-	-
中 信 证 券	2021121400001 455	芒 果 超 媒	2021-12- 14	2,754,400.0 0	55,000.00	14	3.30	3,534.81	-	-
中 信 证 券	2021121400001 498	广 和 通	2021-12- 14	2,743,510.0 0	49,000.00	14	3.10	3,307.45	-	-
中 信 证 券	2021121400001 516	光 弘 科 技	2021-12- 14	1,420,848.0 0	93,600.00	14	3.60	1,989.19	-	-
中 信	2021121400011 884	网 宿	2021-12- 14	4,702,350.0 0	705,000.0 0	14	2.70	4,937.47	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021121400011 886	信 维 通 信	2021-12- 14	5,536,338.0 0	213,100.0 0	14	3.30	7,104.97	-	-
中 信 证 券	2021121400011 888	电 连 技 术	2021-12- 14	246,050.00	5,000.00	14	3.80	363.61	-	-
中 信 证 券	2021121600001 501	天 孚 通 信	2021-12- 16	34,010.00	1,000.00	14	3.80	50.26	-	-
中 信 证 券	2021121600001 503	电 连 技 术	2021-12- 16	2,004,372.0 0	40,200.00	14	3.80	2,962.02	-	-
中 信 证 券	2021121600001 511	中 科 创 达	2021-12- 16	599,760.00	4,000.00	14	3.20	746.37	-	-
中 信 证 券	2021121600001 552	数 码 视 讯	2021-12- 16	3,468,600.0 0	369,000.0 0	14	3.50	4,721.15	-	-
中 信 证 券	2021121600007 531	光 弘 科 技	2021-12- 16	143,808.00	9,600.00	28	3.50	209.72	144,67 2.00	209.72
中 信 证 券	2021121600008 283	光 弘 科 技	2021-12- 16	775,964.00	51,800.00	14	3.60	1,086.35	-	-
中 信 证 券	2021121600008 285	天 孚 通 信	2021-12- 16	3,826,125.0 0	112,500.0 0	14	3.80	5,654.16	-	-
中 信 证 券	2021121600008 287	信 维 通 信	2021-12- 16	2,222,156.0 0	86,600.00	14	3.30	2,851.77	-	-
中 信 证 券	2021121600008 289	电 连 技 术	2021-12- 16	3,091,320.0 0	62,000.00	14	3.80	4,568.28	-	-

券		术								
中信 证券	2021121600008 291	新 易 盛	2021-12- 16	717,400.00	20,000.00	14	3.40	948.56	-	-
中信 证券	2021121600008 293	长 盈 精 密	2021-12- 16	283,500.00	14,000.00	14	3.10	341.78	-	-
中信 证券	2021121600008 295	蓝 思 科 技	2021-12- 16	315,640.00	13,000.00	14	2.10	257.77	-	-
中信 证券	2021121600008 297	电 连 技 术	2021-12- 16	3,141,180.0 0	63,000.00	14	3.80	4,641.97	-	-
中信 证券	2021121600008 299	网 宿 科 技	2021-12- 16	184,680.00	27,000.00	28	2.60	200.07	180,63 0.00	200.07
中信 证券	2021121600008 309	网 宿 科 技	2021-12- 16	5,369,400.0 0	785,000.0 0	14	2.70	5,637.87	-	-
中信 证券	2021121700027 054	广 和 通	2021-12- 17	2,274,148.0 0	43,700.00	14	3.10	2,741.61	-	-
中信 证券	2021121700027 056	天 孚 通 信	2021-12- 17	525,760.00	16,000.00	14	3.80	776.96	-	-
中信 证券	2021121700027 058	电 连 技 术	2021-12- 17	2,460,000.0 0	50,000.00	14	3.80	3,635.33	-	-
中信 证券	2021121700027 060	东 方 国 信	2021-12- 17	572,442.00	53,300.00	14	4.10	912.73	-	-
中信 证券	2021121700027 062	信 维 通 信	2021-12- 17	1,740,200.0 0	70,000.00	14	3.30	2,233.26	-	-

中信证券	2021121700027064	网宿科技	2021-12-17	4,015,980.00	603,000.00	14	2.70	4,216.78	-	-
中信证券	2021122100001524	新易盛	2021-12-21	2,265,744.00	62,400.00	14	3.50	2,202.81	2,444,832.00	2,202.81
中信证券	2021122100001532	蓝思科技	2021-12-21	40,171.00	1,700.00	14	2.10	23.44	39,066.00	23.44
中信证券	2021122100001559	数码视讯	2021-12-21	1,719,579.00	185,100.00	14	3.60	1,719.58	1,634,433.00	1,719.58
中信证券	20211221000019755	中科创达	2021-12-21	298,400.00	2,000.00	14	3.20	265.24	276,840.00	265.24
中信证券	20211221000019757	光弘科技	2021-12-21	2,187,280.00	152,000.00	14	3.60	2,187.28	2,290,640.00	2,187.28
中信证券	20211221000019759	新易盛	2021-12-21	2,033,360.00	56,000.00	14	3.40	1,920.39	2,194,080.00	1,920.39
中信证券	20211221000019761	长盈精密	2021-12-21	276,080.00	14,000.00	14	3.10	237.74	277,760.00	237.74
中信证券	20211221000019763	长盈精密	2021-12-21	236,640.00	12,000.00	14	3.10	203.77	238,080.00	203.77
中信证券	20211221000019765	信维通信	2021-12-21	298,080.00	12,000.00	14	3.30	273.24	303,840.00	273.24
中信证券	20211221000019767	芒果超媒	2021-12-21	550,660.00	11,000.00	14	3.30	504.77	629,420.00	504.77
中	20211221000019	中	2021-12-	4,476,000.0	30,000.00	14	3.20	3,978.66	4,152,6	3,978.6

信 证 券	769	科 创 达	21	0					00.00	6
中 信 证 券	2021122100019 771	芒 果 超 媒	2021-12- 21	50,060.00	1,000.00	14	3.30	45.89	57,220. 00	45.89
中 信 证 券	2021122100019 773	中 际 旭 创	2021-12- 21	5,286,250.0 0	125,000.0 0	14	3.50	5,139.41	5,312,5 00.00	5,139.4 1
中 信 证 券	2021122300000 948	电 连 技 术	2021-12- 23	210,480.00	4,000.00	14	3.80	177.74	210,00 0.00	177.74
中 信 证 券	2021122300000 951	新 易 盛	2021-12- 23	2,313,792.0 0	62,400.00	14	3.50	1,799.62	2,444,8 32.00	1,799.6 2
中 信 证 券	2021122300000 956	天 孚 通 信	2021-12- 23	1,330,000.0 0	40,000.00	14	3.80	1,123.11	1,464,0 00.00	1,123.1 1
中 信 证 券	2021122300000 970	信 维 通 信	2021-12- 23	25,740.00	1,000.00	14	3.50	20.02	25,320. 00	20.02
中 信 证 券	2021122300000 981	数 码 视 讯	2021-12- 23	718,704.00	74,400.00	14	3.60	574.97	656,95 2.00	574.97
中 信 证 券	2021122300011 499	中 科 创 达	2021-12- 23	310,580.00	2,000.00	14	3.20	220.86	276,84 0.00	220.86
中 信 证 券	2021122700001 107	东 方 国 信	2021-12- 27	732,900.00	70,000.00	14	3.60	293.16	756,00 0.00	293.16
中 信 证 券	2021122700001 110	天 孚 通 信	2021-12- 27	726,336.00	20,800.00	14	3.90	314.75	761,28 0.00	314.75
中 信	2021122700001 112	数 码	2021-12- 27	1,787,007.0 0	203,300.0 0	14	3.60	714.80	1,795,1 39.00	714.80

证 券		视 讯								
中 信 证 券	2021122800001 548	芒 果 超 媒	2021-12- 28	940,680.00	18,000.00	14	3.50	274.37	1,029,9 60.00	274.37
中 信 证 券	2021122800001 556	电 连 技 术	2021-12- 28	2,030,717.0 0	40,300.00	14	3.90	659.98	2,115,7 50.00	659.98
中 信 证 券	2021122800013 996	广 和 通	2021-12- 28	2,655,800.0 0	49,000.00	14	3.30	730.35	2,670,5 00.00	730.35
中 信 证 券	2021122800013 998	芒 果 超 媒	2021-12- 28	2,874,300.0 0	55,000.00	14	3.40	814.38	3,147,1 00.00	814.38
中 信 证 券	2021122800014 000	数 码 视 讯	2021-12- 28	2,099,529.0 0	236,700.0 0	14	3.60	629.86	2,090,0 61.00	629.86
中 信 证 券	2021122800014 002	光 弘 科 技	2021-12- 28	1,393,704.0 0	93,600.00	14	3.70	429.73	1,410,5 52.00	429.73
中 信 证 券	2021122800014 004	电 连 技 术	2021-12- 28	251,950.00	5,000.00	14	3.80	79.79	262,50 0.00	79.79
中 信 证 券	2021122800014 008	网 宿 科 技	2021-12- 28	4,653,000.0 0	705,000.0 0	14	3.50	1,357.13	4,716,4 50.00	1,357.1 3
中 信 证 券	2021122800014 010	信 维 通 信	2021-12- 28	5,472,408.0 0	213,100.0 0	14	3.50	1,596.12	5,395,6 92.00	1,596.1 2
中 信 证 券	2021122900001 025	光 环 新 网	2021-12- 29	2,465,820.0 0	171,000.0 0	14	3.60	493.16	2,537,6 40.00	493.16
中 信 证 券	2021123000001 470	芒 果 超	2021-12- 30	990,000.00	18,000.00	14	3.50	96.25	1,029,9 60.00	96.25

券		媒								
中信 证券	2021123000009 298	电 连 技 术	2021-12- 30	3,187,420.0 0	62,000.00	14	3.80	336.45	3,255,0 00.00	336.45
中信 证券	2021123000009 300	电 连 技 术	2021-12- 30	2,066,682.0 0	40,200.00	14	3.80	218.15	2,110,5 00.00	218.15
中信 证券	2021123000009 302	天 孚 通 信	2021-12- 30	36,180.00	1,000.00	14	3.80	3.82	36,600. 00	3.82
中信 证券	2021123000009 304	长 盈 精 密	2021-12- 30	275,800.00	14,000.00	14	3.50	26.81	277,76 0.00	26.81
中信 证券	2021123000009 306	新 易 盛	2021-12- 30	772,600.00	20,000.00	14	3.50	75.11	783,60 0.00	75.11
中信 证券	2021123000009 308	数 码 视 讯	2021-12- 30	3,177,090.0 0	369,000.0 0	14	3.60	317.71	3,258,2 70.00	317.71
中信 证券	2021123000009 310	电 连 技 术	2021-12- 30	3,238,830.0 0	63,000.00	14	3.80	341.88	3,307,5 00.00	341.88
中信 证券	2021123000009 312	网 宿 科 技	2021-12- 30	5,235,950.0 0	785,000.0 0	14	3.50	509.05	5,251,6 50.00	509.05
中信 证券	2021123000009 314	信 维 通 信	2021-12- 30	2,212,630.0 0	86,600.00	14	3.50	215.12	2,192,7 12.00	215.12
中信 证券	2021123000009 316	天 孚 通 信	2021-12- 30	4,070,250.0 0	112,500.0 0	14	3.80	429.64	4,117,5 00.00	429.64
中信 证券	2021123000009 318	光 弘 科 技	2021-12- 30	782,698.00	51,800.00	14	3.70	80.44	780,62 6.00	80.44

中信证券	2021123100001148	光弘科技	2021-12-31	638,968.00	42,400.00	14	3.60	-	638,968.00	-
中信证券	20211231000024394	网宿科技	2021-12-31	4,034,070.00	603,000.00	14	3.50	-	4,034,070.00	-
中信证券	20211231000024396	广和通	2021-12-31	2,381,650.00	43,700.00	14	3.30	-	2,381,650.00	-
中信证券	20211231000025672	天孚通信	2021-12-31	585,600.00	16,000.00	14	3.80	-	585,600.00	-
中信证券	20211231000025674	电连技术	2021-12-31	2,625,000.00	50,000.00	14	3.80	-	2,625,000.00	-
中信证券	20211231000025676	信维通信	2021-12-31	1,772,400.00	70,000.00	14	3.50	-	1,772,400.00	-
中信证券	20211231000025678	东方国信	2021-12-31	575,640.00	53,300.00	14	3.60	-	575,640.00	-
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	2020032400000579	高新兴	2020-03-24	903,500.00	130,000.00	14	1.70	597.31	-	-
中	2020032400000	天	2020-03-	628,048.00	13,600.00	28	1.80	879.27	-	-

信 证 券	687	孚 通 信	24							
中 信 证 券	2020032600000 769	高 新 兴	2020-03- 26	2,061,000.0 0	300,000.0 0	14	1.70	1,362.55	-	-
中 信 证 券	2020032600000 867	飞 荣 达	2020-03- 26	484,300.00	10,000.00	28	1.80	678.02	-	-
中 信 证 券	2020033100000 500	硕 贝 德	2020-03- 31	331,200.00	20,000.00	28	1.80	463.68	-	-
中 信 证 券	2020040200000 870	硕 贝 德	2020-04- 02	1,345,040.0 0	78,200.00	28	1.80	1,883.06	-	-
中 信 证 券	2020040700000 579	电 连 技 术	2020-04- 07	663,040.00	18,500.00	28	1.80	961.41	-	-
中 信 证 券	2020040900000 541	天 孚 通 信	2020-04- 09	732,765.00	16,500.00	28	1.80	1,025.87	-	-
中 信 证 券	2020040900000 558	电 连 技 术	2020-04- 09	544,800.00	15,000.00	28	1.80	762.72	-	-
中 信 证 券	2020041400000 284	长 盈 精 密	2020-04- 14	399,000.00	20,000.00	14	1.70	263.78	-	-
中 信 证 券	2020042800000 613	中 际 旭 创	2020-04- 28	639,100.00	10,000.00	14	1.70	422.52	-	-
中 信 证 券	2020050700001 280	天 孚 通 信	2020-05- 07	1,280,250.0 0	25,000.00	14	1.70	846.39	-	-
中 信	2020060200002 319	飞 荣	2020-06- 02	4,586,000.0 0	100,000.0 0	14	1.70	3,031.86	-	-

证 券		达								
中 信 证 券	2020060200004 628	飞 荣 达	2020-06- 02	9,486.08	-	14	1.70	-	-	-
中 信 证 券	2020060200004 640	飞 荣 达	2020-06- 02	-	56,917.00	14	1.70	-	-	-
中 信 证 券	2020060400000 570	中 际 旭 创	2020-06- 04	16,651,833. 00	281,900.0 0	14	1.70	11,008.71	-	-
中 信 证 券	2020060900000 439	高 新 兴	2020-06- 09	382,500.00	62,500.00	28	1.80	535.50	-	-
中 信 证 券	2020061100000 312	飞 荣 达	2020-06- 11	288,500.00	10,000.00	28	1.80	403.90	-	-
中 信 证 券	2020061100000 314	广 和 通	2020-06- 11	608,835.00	11,100.00	28	1.80	852.37	-	-
中 信 证 券	2020061100000 323	电 连 技 术	2020-06- 11	391,288.00	11,800.00	28	1.80	547.80	-	-
中 信 证 券	2020061600008 068	飞 荣 达	2020-06- 16	2,921,000.0 0	100,000.0 0	14	1.70	1,931.11	-	-
中 信 证 券	2020061800000 469	高 新 兴	2020-06- 18	501,930.00	84,500.00	28	1.80	702.70	-	-
中 信 证 券	2020061800000 473	长 盈 精 密	2020-06- 18	521,458.00	23,800.00	28	1.80	730.04	-	-
中 信 证 券	2020061800000 477	信 维 通	2020-06- 18	524,300.00	10,700.00	28	1.80	734.02	-	-

券		信								
中信 证券	2020061800000 508	硕 贝 德	2020-06- 18	515,610.00	30,600.00	28	1.80	721.85	-	-
中信 证券	2020061800000 513	中 际 旭 创	2020-06- 18	635,300.00	10,000.00	28	1.80	889.42	-	-
中信 证券	2020061800000 525	天 孚 通 信	2020-06- 18	547,000.00	10,000.00	28	1.80	765.80	-	-
中信 证券	2020061800000 539	飞 荣 达	2020-06- 18	517,548.00	17,200.00	28	1.80	724.57	-	-
中信 证券	2020061800000 543	新 易 盛	2020-06- 18	575,900.00	10,000.00	28	1.80	806.26	-	-
中信 证券	2020061800000 544	电 连 技 术	2020-06- 18	502,452.00	15,300.00	28	1.80	703.43	-	-
中信 证券	2020061800000 548	光 弘 科 技	2020-06- 18	504,434.00	27,400.00	28	1.80	706.21	-	-
中信 证券	2020062200013 373	信 维 通 信	2020-06- 22	535.00	-	28	1.80	-	-	-
中信 证券	2020063000008 640	飞 荣 达	2020-06- 30	3,282,000.0 0	100,000.0 0	14	1.70	2,169.77	-	-
中信 证券	2020070100000 944	飞 荣 达	2020-07- 01	4,887,000.0 0	150,000.0 0	28	1.80	6,841.80	-	-
中信 证券	2020070100013 988	中 际 旭 创	2020-07- 01	840.00	-	28	1.80	-	-	-

中信证券	2020070200000630	广和通	2020-07-02	1,027,425.00	17,500.00	14	1.70	679.24	-	-
中信证券	2020070700003168	高新兴	2020-07-07	443,125.00	62,500.00	28	1.80	620.38	-	-
中信证券	2020070900000369	高新兴	2020-07-09	77,100.00	10,000.00	14	1.70	50.97	-	-
中信证券	2020071400000529	天孚通信	2020-07-14	1,441,200.00	20,000.00	14	1.70	952.79	-	-
中信证券	2020071400000556	中科创达	2020-07-14	1,470,960.00	13,500.00	28	1.80	2,059.34	-	-
中信证券	2020071400000578	新易盛	2020-07-14	1,465,560.00	18,000.00	14	1.70	968.90	-	-
中信证券	2020071400000581	飞荣达	2020-07-14	332,600.00	10,000.00	14	1.70	219.89	-	-
中信证券	2020071400000515	飞荣达	2020-07-14	3,326,000.00	100,000.00	14	1.70	2,198.86	-	-
中信证券	20200716000001460	硕贝德	2020-07-16	509,796.00	30,600.00	28	1.80	713.71	-	-
中信证券	20200716000001592	中际旭创	2020-07-16	609,000.00	10,000.00	28	1.80	852.60	-	-
中信证券	20200716000001594	高新兴	2020-07-16	550,940.00	84,500.00	28	1.80	771.32	-	-
中	20200716000001	天	2020-07-	633,700.00	10,000.00	28	1.80	887.18	-	-

信 证 券	602	孚 通 信	16							
中 信 证 券	2020071600001 606	电 连 技 术	2020-07- 16	504,135.00	15,300.00	28	1.80	705.79	-	-
中 信 证 券	2020071600001 610	飞 荣 达	2020-07- 16	512,560.00	17,200.00	28	1.80	717.58	-	-
中 信 证 券	2020071600001 612	新 易 盛	2020-07- 16	688,000.00	10,000.00	28	1.80	963.20	-	-
中 信 证 券	2020071600001 616	信 维 通 信	2020-07- 16	538,638.00	10,700.00	28	1.80	754.09	-	-
中 信 证 券	2020071600001 646	广 和 通	2020-07- 16	1,022,000.0 0	17,500.00	14	1.70	675.66	-	-
中 信 证 券	2020071600001 656	长 盈 精 密	2020-07- 16	550,970.00	23,800.00	28	1.80	771.36	-	-
中 信 证 券	2020071600001 666	光 弘 科 技	2020-07- 16	539,232.00	27,400.00	28	1.80	754.92	-	-
中 信 证 券	2020072300000 438	新 易 盛	2020-07- 23	9,827,010.0 0	137,000.0 0	28	1.80	13,757.81	-	-
中 信 证 券	2020072300001 519	高 新 兴	2020-07- 23	64,900.00	10,000.00	14	1.70	42.91	-	-
中 信 证 券	2020072800007 901	天 孚 通 信	2020-07- 28	1,435,600.0 0	20,000.00	14	1.70	949.09	-	-
中 信	2020072800007 903	飞 荣	2020-07- 28	290,900.00	10,000.00	14	1.70	192.32	-	-

证券		达								
中信证券	2020072800008047	飞荣达	2020-07-28	2,909,000.00	100,000.00	14	1.70	1,923.17	-	-
中信证券	2020072800008355	新易盛	2020-07-28	1,268,100.00	18,000.00	14	1.70	838.36	-	-
中信证券	2020072900004448	飞荣达	2020-07-29	4,509,000.00	150,000.00	28	1.80	6,312.60	-	-
中信证券	2020073000003828	广和通	2020-07-30	1,137,325.00	17,500.00	14	1.70	751.90	-	-
中信证券	2020080400000497	高新兴	2020-08-04	870,387.00	133,700.00	14	1.70	575.42	-	-
中信证券	2020080400000547	广和通	2020-08-04	1,242,720.00	16,000.00	14	1.70	821.58	-	-
中信证券	20200804000002617	高新兴	2020-08-04	406,875.00	62,500.00	28	1.80	569.63	-	-
中信证券	20200806000002301	高新兴	2020-08-06	64,800.00	10,000.00	14	1.70	42.84	-	-
中信证券	2020081100005543	新易盛	2020-08-11	1,245,420.00	18,000.00	14	1.70	823.36	-	-
中信证券	2020081100005553	天孚通信	2020-08-11	1,364,000.00	20,000.00	14	1.70	901.76	-	-
中信证	2020081100005555	飞荣达	2020-08-11	290,100.00	10,000.00	14	1.70	191.79	-	-

券										
中信证券	202008110000557	中科 创达	2020-08-11	1,215,000.00	13,500.00	28	1.80	1,701.00	-	-
中信证券	202008110000559	飞 荣达	2020-08-11	2,901,000.00	100,000.00	14	1.70	1,917.88	-	-
中信证券	2020081300002545	广和 通	2020-08-13	1,284,325.00	17,500.00	14	1.70	849.08	-	-
中信证券	2020081300002599	信维 通信	2020-08-13	600,270.00	10,700.00	28	1.80	840.38	-	-
中信证券	2020081300002601	中际 旭创	2020-08-13	548,900.00	10,000.00	28	1.80	768.46	-	-
中信证券	2020081300002603	长盈 精密	2020-08-13	525,266.00	23,800.00	28	1.80	735.37	-	-
中信证券	2020081300002605	硕贝 德	2020-08-13	486,846.00	30,600.00	28	1.80	681.58	-	-
中信证券	2020081300002611	高新 兴	2020-08-13	512,070.00	84,500.00	28	1.80	716.90	-	-
中信证券	2020081300002613	天孚 通信	2020-08-13	658,400.00	10,000.00	28	1.80	921.76	-	-
中信证券	2020081300002615	光弘 科技	2020-08-13	499,776.00	27,400.00	28	1.80	699.69	-	-
中信证券	2020081300002617	新易 盛	2020-08-13	679,200.00	10,000.00	28	1.80	950.88	-	-

中信证券	2020081300002619	飞荣达	2020-08-13	489,340.00	17,200.00	28	1.80	685.08	-	-
中信证券	2020081300002621	电连技术	2020-08-13	471,852.00	15,300.00	28	1.80	660.59	-	-
中信证券	2020081800003141	高新兴	2020-08-18	838,299.00	133,700.00	14	1.70	554.21	-	-
中信证券	2020081800003451	广和通	2020-08-18	1,172,000.00	16,000.00	14	1.70	774.82	-	-
中信证券	2020082000000915	广和通	2020-08-20	3,000,940.00	45,400.00	28	1.80	4,201.32	-	-
中信证券	2020082000003134	新易盛	2020-08-20	8,903,630.00	137,000.00	28	1.80	12,465.08	-	-
中信证券	2020082500000478	中科创达	2020-08-25	3,031,290.00	32,700.00	14	3.20	3,772.27	-	-
中信证券	2020082500008933	天孚通信	2020-08-25	1,347,600.00	20,000.00	14	1.70	890.91	-	-
中信证券	2020082500008937	飞荣达	2020-08-25	3,048,000.00	100,000.00	14	1.70	2,015.07	-	-
中信证券	2020082500008939	新易盛	2020-08-25	1,235,340.00	18,000.00	14	1.70	816.70	-	-
中信证券	2020082500008943	飞荣达	2020-08-25	304,800.00	10,000.00	14	1.70	201.51	-	-
中	2020082600007	飞	2020-08-	4,387,500.0	150,000.0	28	1.80	6,142.50	-	-

信 证 券	193	荣 达	26	0	0					
中 信 证 券	2020082700003 771	广 和 通	2020-08- 27	1,225,000.0 0	17,500.00	14	1.70	809.86	-	-
中 信 证 券	2020090100000 464	高 新 兴	2020-09- 01	1,365,860.0 0	220,300.0 0	14	3.40	1,805.97	-	-
中 信 证 券	2020090300000 399	高 新 兴	2020-09- 03	254,400.00	40,000.00	14	3.40	336.37	-	-
中 信 证 券	2020090300000 409	光 弘 科 技	2020-09- 03	991,287.00	52,700.00	28	3.10	3,072.99	-	-
中 信 证 券	2020090300000 413	电 连 技 术	2020-09- 03	978,614.00	28,300.00	28	3.50	3,425.14	-	-
中 信 证 券	2020090300000 427	大 富 科 技	2020-09- 03	746,500.00	50,000.00	14	3.40	987.04	-	-
中 信 证 券	2020090800000 291	飞 荣 达	2020-09- 08	1,965,600.0 0	70,000.00	28	3.40	5,754.84	-	-
中 信 证 券	2020090800000 351	硕 贝 德	2020-09- 08	896,000.00	50,000.00	14	3.50	1,219.56	-	-
中 信 证 券	2020090800000 401	大 富 科 技	2020-09- 08	318,800.00	20,000.00	14	3.70	458.72	-	-
中 信 证 券	2020090800000 417	高 新 兴	2020-09- 08	1,436,000.0 0	200,000.0 0	14	3.50	1,954.56	-	-
中 信	2020090800005 921	飞 荣	2020-09- 08	280,800.00	10,000.00	14	3.60	393.12	-	-

证券		达								
中信证券	2020090800005923	飞荣达	2020-09-08	2,808,000.00	100,000.00	14	3.60	3,931.20	-	-
中信证券	2020090800005925	新易盛	2020-09-08	1,112,220.00	18,000.00	14	3.60	1,557.11	-	-
中信证券	2020090800005927	天孚通信	2020-09-08	1,222,000.00	20,000.00	14	3.20	1,520.71	-	-
中信证券	2020091000000534	硕贝德	2020-09-10	905,634.00	55,800.00	28	3.40	2,480.43	-	-
中信证券	2020091000000542	光弘科技	2020-09-10	292,918.00	16,700.00	14	3.30	375.91	-	-
中信证券	2020091000000608	光弘科技	2020-09-10	882,262.00	50,300.00	28	3.20	2,274.27	-	-
中信证券	2020091000000620	硕贝德	2020-09-10	4,026,663.00	248,100.00	14	3.50	5,480.74	-	-
中信证券	2020091000000647	信维通信	2020-09-10	607,118.00	10,700.00	28	3.30	1,613.92	-	-
中信证券	2020091000000649	高新兴	2020-09-10	479,960.00	84,500.00	28	3.40	1,314.56	-	-
中信证券	2020091000000653	天孚通信	2020-09-10	572,900.00	10,000.00	28	3.40	1,569.11	-	-
中信证	2020091000000655	新易盛	2020-09-10	573,200.00	10,000.00	28	3.40	1,569.94	-	-

券										
中信 证券	2020091000004 657	中 际 旭 创	2020-09- 10	505,100.00	10,000.00	28	3.20	1,302.04	-	-
中信 证券	2020091000004 659	硕 贝 德	2020-09- 10	496,638.00	30,600.00	28	3.40	1,360.23	-	-
中信 证券	2020091000004 661	光 弘 科 技	2020-09- 10	480,596.00	27,400.00	28	3.20	1,238.87	-	-
中信 证券	2020091000004 665	飞 荣 达	2020-09- 10	429,484.00	17,200.00	28	3.40	1,176.31	-	-
中信 证券	2020091000004 667	电 连 技 术	2020-09- 10	517,293.00	15,300.00	28	3.40	1,416.81	-	-
中信 证券	2020091000004 673	长 盈 精 密	2020-09- 10	528,122.00	23,800.00	28	3.30	1,403.92	-	-
中信 证券	2020091500000 414	高 新 兴	2020-09- 15	1,287,380.0 0	218,200.0 0	14	3.50	1,752.27	-	-
中信 证券	2020091500000 418	信 维 通 信	2020-09- 15	29,504,160. 00	504,000.0 0	14	3.40	39,011.06	-	-
中信 证券	2020091500000 420	硕 贝 德	2020-09- 15	864,000.00	50,000.00	14	3.50	1,176.00	-	-
中信 证券	2020091500003 906	高 新 兴	2020-09- 15	1,299,770.0 0	220,300.0 0	14	3.50	1,769.13	-	-
中信 证券	2020091700000 483	大 富 科 技	2020-09- 17	526,176.00	37,800.00	28	3.60	1,473.29	-	-

中信 证券	2020091700000 485	天 孚 通 信	2020-09- 17	1,011,704.0 0	17,200.00	28	3.40	2,675.40	-	-
中信 证券	2020091700000 487	光 弘 科 技	2020-09- 17	218,000.00	12,500.00	14	3.30	439.64	-	-
中信 证券	2020091700000 489	高 新 兴	2020-09- 17	107,880.00	18,600.00	14	3.50	230.75	-	-
中信 证券	2020091700004 432	高 新 兴	2020-09- 17	232,000.00	40,000.00	14	3.50	496.22	-	-
中信 证券	2020091700004 436	大 富 科 技	2020-09- 17	696,000.00	50,000.00	14	3.70	1,573.74	-	-
中信 证券	2020091700004 438	新 易 盛	2020-09- 17	8,603,600.0 0	137,000.0 0	28	3.40	22,751.74	-	-
中信 证券	2020092200006 731	硕 贝 德	2020-09- 22	894,500.00	50,000.00	14	3.50	1,478.41	-	-
中信 证券	2020092200006 909	新 易 盛	2020-09- 22	1,136,340.0 0	18,000.00	14	3.50	1,878.12	-	-
中信 证券	2020092200006 911	飞 荣 达	2020-09- 22	262,000.00	10,000.00	14	3.50	433.03	-	-
中信 证券	2020092200006 913	天 孚 通 信	2020-09- 22	1,145,600.0 0	20,000.00	14	3.50	1,893.42	-	-
中信 证券	2020092200006 915	高 新 兴	2020-09- 22	1,106,000.0 0	200,000.0 0	14	3.50	1,827.97	-	-
中	2020092200006	大	2020-09-	272,200.00	20,000.00	14	3.70	475.60	-	-

信 证 券	917	富 科 技	22							
中 信 证 券	2020092200006 919	飞 荣 达	2020-09- 22	2,620,000.0 0	100,000.0 0	14	3.50	4,330.28	-	-
中 信 证 券	2020092300014 505	飞 荣 达	2020-09- 23	3,952,500.0 0	150,000.0 0	28	3.40	10,452.17	-	-
中 信 证 券	2020092400000 312	光 弘 科 技	2020-09- 24	205,625.00	12,500.00	14	3.40	291.30	-	-
中 信 证 券	2020092400003 710	光 弘 科 技	2020-09- 24	274,715.00	16,700.00	14	3.30	377.73	-	-
中 信 证 券	2020092400003 714	硕 贝 德	2020-09- 24	4,468,281.0 0	248,100.0 0	14	3.50	6,516.25	-	-
中 信 证 券	2020092900005 027	硕 贝 德	2020-09- 29	807,500.00	50,000.00	14	3.70	1,161.90	-	-
中 信 证 券	2020092900005 039	高 新 兴	2020-09- 29	1,108,109.0 0	220,300.0 0	14	3.70	1,594.45	-	-
中 信 证 券	2020092900005 043	高 新 兴	2020-09- 29	1,097,546.0 0	218,200.0 0	14	3.70	1,579.25	-	-
中 信 证 券	2020100900033 215	新 易 盛	2020-10- 09	1,174,860.0 0	18,000.00	14	3.70	1,690.49	-	-
中 信 证 券	2020100900033 217	天 孚 通 信	2020-10- 09	1,130,000.0 0	20,000.00	14	3.50	1,538.06	-	-
中 信	2020100900033 219	硕 贝	2020-10- 09	813,000.00	50,000.00	14	3.70	1,169.82	-	-

证 券		德								
中 信 证 券	2020100900033 221	电 连 技 术	2020-10- 09	1,102,285.0 0	28,300.00	28	3.60	3,086.40	-	-
中 信 证 券	2020100900033 223	光 弘 科 技	2020-10- 09	887,468.00	52,700.00	28	3.30	2,277.83	-	-
中 信 证 券	2020100900033 225	高 新 兴	2020-10- 09	1,028,000.0 0	200,000.0 0	14	3.70	1,479.18	-	-
中 信 证 券	2020100900033 227	飞 荣 达	2020-10- 09	1,828,400.0 0	70,000.00	28	3.60	5,119.52	-	-
中 信 证 券	2020100900033 229	硕 贝 德	2020-10- 09	497,556.00	30,600.00	28	3.60	1,393.16	-	-
中 信 证 券	2020100900033 231	硕 贝 德	2020-10- 09	907,308.00	55,800.00	28	3.60	2,540.46	-	-
中 信 证 券	2020100900033 233	天 孚 通 信	2020-10- 09	565,000.00	10,000.00	28	3.40	1,494.11	-	-
中 信 证 券	2020100900033 235	光 弘 科 技	2020-10- 09	847,052.00	50,300.00	28	3.30	2,174.10	-	-
中 信 证 券	2020100900033 237	新 易 盛	2020-10- 09	652,700.00	10,000.00	28	3.60	1,827.56	-	-
中 信 证 券	2020100900033 239	飞 荣 达	2020-10- 09	2,612,000.0 0	100,000.0 0	14	3.70	3,758.38	-	-
中 信 证 券	2020100900033 243	高 新 兴	2020-10- 09	205,600.00	40,000.00	14	3.70	295.84	-	-

券										
中信 证券	2020100900033 245	高 新 兴	2020-10- 09	95,604.00	18,600.00	14	3.70	137.56	-	-
中信 证券	2020100900033 247	光 弘 科 技	2020-10- 09	210,500.00	12,500.00	14	3.40	278.33	-	-
中信 证券	2020100900033 251	大 富 科 技	2020-10- 09	677,500.00	50,000.00	14	4.00	1,053.89	-	-
中信 证券	2020100900033 255	大 富 科 技	2020-10- 09	271,000.00	20,000.00	14	4.00	421.56	-	-
中信 证券	2020100900033 257	飞 荣 达	2020-10- 09	261,200.00	10,000.00	14	3.70	375.84	-	-
中信 证券	2020100900033 259	光 弘 科 技	2020-10- 09	461,416.00	27,400.00	28	3.30	1,184.30	-	-
中信 证券	2020100900033 261	高 新 兴	2020-10- 09	434,330.00	84,500.00	28	3.60	1,216.12	-	-
中信 证券	2020100900033 263	中 际 旭 创	2020-10- 09	512,900.00	10,000.00	28	3.20	1,276.55	-	-
中信 证券	2020100900033 265	电 连 技 术	2020-10- 09	595,935.00	15,300.00	28	3.60	1,668.62	-	-
中信 证券	2020100900033 267	飞 荣 达	2020-10- 09	449,264.00	17,200.00	28	3.60	1,257.94	-	-
中信 证券	2020100900033 269	长 盈 精 密	2020-10- 09	615,944.00	23,800.00	28	3.30	1,580.92	-	-

中信 证券	2020100900033 271	信 维 通 信	2020-10- 09	620,814.00	10,700.00	28	3.40	1,641.71	-	-
中信 证券	2020100900033 575	光 弘 科 技	2020-10- 09	210,500.00	12,500.00	14	3.40	278.33	-	-
中信 证券	2020100900033 579	光 弘 科 技	2020-10- 09	281,228.00	16,700.00	14	3.40	371.85	-	-
中信 证券	2020100900033 581	硕 贝 德	2020-10- 09	4,034,106.0 0	248,100.0 0	14	3.70	5,804.63	-	-
中信 证券	2020101300000 815	长 盈 精 密	2020-10- 13	388,245.00	14,300.00	14	3.40	513.35	-	-
中信 证券	2020101300000 821	信 维 通 信	2020-10- 13	529,500.00	10,000.00	14	3.50	720.71	-	-
中信 证券	2020101300000 833	高 新 兴	2020-10- 13	113,069.00	20,900.00	14	3.50	153.90	-	-
中信 证券	2020101300000 839	光 弘 科 技	2020-10- 13	808,680.00	46,000.00	14	3.50	1,100.70	-	-
中信 证券	2020101300000 841	电 连 技 术	2020-10- 13	440,160.00	10,500.00	28	3.40	1,163.98	-	-
中信 证券	2020101300000 845	电 连 技 术	2020-10- 13	2,096,000.0 0	50,000.00	14	3.50	2,852.89	-	-
中信 证券	2020101300007 566	高 新 兴	2020-10- 13	1,191,823.0 0	220,300.0 0	14	3.70	1,714.90	-	-
中	2020101300007	高	2020-10-	1,180,462.0	218,200.0	14	3.70	1,698.55	-	-

信 证 券	568	新 兴	13	0	0					
中 信 证 券	2020101300007 572	硕 贝 德	2020-10- 13	852,500.00	50,000.00	14	3.70	1,226.65	-	-
中 信 证 券	2020101500000 536	硕 贝 德	2020-10- 15	286,230.00	17,400.00	14	3.50	389.59	-	-
中 信 证 券	2020101500000 538	电 连 技 术	2020-10- 15	435,225.00	10,500.00	14	3.50	592.39	-	-
中 信 证 券	2020101500000 558	长 盈 精 密	2020-10- 15	267,400.00	10,000.00	14	3.40	353.56	-	-
中 信 证 券	2020101500002 922	天 孚 通 信	2020-10- 15	1,044,212.0 0	17,200.00	28	3.40	2,761.36	-	-
中 信 证 券	2020101500002 924	新 易 盛	2020-10- 15	9,553,010.0 0	137,000.0 0	28	3.60	26,748.43	-	-
中 信 证 券	2020101500002 926	大 富 科 技	2020-10- 15	503,874.00	37,800.00	28	3.90	1,528.42	-	-
中 信 证 券	2020102000000 424	光 弘 科 技	2020-10- 20	3,452,000.0 0	200,000.0 0	14	3.50	4,698.56	-	-
中 信 证 券	2020102100005 100	飞 荣 达	2020-10- 21	3,789,000.0 0	150,000.0 0	28	3.40	10,019.80	-	-
中 信 证 券	2020102300026 650	光 弘 科 技	2020-10- 23	207,000.00	12,500.00	14	3.50	281.75	-	-
中 信	2020102300026 652	光 弘	2020-10- 23	207,000.00	12,500.00	14	3.50	281.75	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2020102300026 656	大 富 科 技	2020-10- 23	273,200.00	20,000.00	14	3.50	371.86	-	-
中 信 证 券	2020102300026 658	光 弘 科 技	2020-10- 23	276,552.00	16,700.00	14	3.50	376.42	-	-
中 信 证 券	2020102300026 660	大 富 科 技	2020-10- 23	683,000.00	50,000.00	14	3.50	929.64	-	-
中 信 证 券	2020102300026 662	硕 贝 德	2020-10- 23	795,000.00	50,000.00	14	3.50	1,082.08	-	-
中 信 证 券	2020102300026 664	飞 荣 达	2020-10- 23	249,100.00	10,000.00	14	3.50	339.05	-	-
中 信 证 券	2020102300026 666	天 孚 通 信	2020-10- 23	1,150,200.0 0	20,000.00	14	3.50	1,565.55	-	-
中 信 证 券	2020102300026 668	新 易 盛	2020-10- 23	1,155,600.0 0	18,000.00	14	3.50	1,572.90	-	-
中 信 证 券	2020102300026 670	飞 荣 达	2020-10- 23	2,491,000.0 0	100,000.0 0	14	3.50	3,390.53	-	-
中 信 证 券	2020102300026 672	高 新 兴	2020-10- 23	210,800.00	40,000.00	14	3.50	286.92	-	-
中 信 证 券	2020102300026 674	高 新 兴	2020-10- 23	98,022.00	18,600.00	14	3.50	133.42	-	-
中 信 证 券	2020102700000 643	长 盈 精	2020-10- 27	261,030.00	10,500.00	28	3.20	649.67	-	-

券		密								
中信 证券	2020102700000 645	光 弘 科 技	2020-10- 27	1,631,000.0 0	100,000.0 0	14	3.60	2,283.40	-	-
中信 证券	2020102700009 214	高 新 兴	2020-10- 27	108,680.00	20,900.00	14	3.50	147.93	-	-
中信 证券	2020102700009 216	信 维 通 信	2020-10- 27	489,300.00	10,000.00	14	3.30	627.94	-	-
中信 证券	2020102700009 220	长 盈 精 密	2020-10- 27	355,498.00	14,300.00	14	3.40	470.05	-	-
中信 证券	2020102700009 222	光 弘 科 技	2020-10- 27	750,260.00	46,000.00	14	3.50	1,021.19	-	-
中信 证券	2020102700009 224	电 连 技 术	2020-10- 27	2,071,500.0 0	50,000.00	14	3.60	2,900.10	-	-
中信 证券	2020102700009 226	硕 贝 德	2020-10- 27	796,500.00	50,000.00	14	3.50	1,084.13	-	-
中信 证券	2020102900000 297	高 新 兴	2020-10- 29	106,260.00	21,000.00	28	3.40	281.00	-	-
中信 证券	2020102900000 303	长 盈 精 密	2020-10- 29	831,726.00	32,200.00	14	3.30	1,067.38	-	-
中信 证券	2020102900002 292	电 连 技 术	2020-10- 29	455,175.00	10,500.00	14	3.60	637.25	-	-
中信 证券	2020102900002 294	长 盈 精 密	2020-10- 29	258,300.00	10,000.00	14	3.40	341.53	-	-

中信证券	2020102900002300	硕贝德	2020-10-29	267,960.00	17,400.00	14	3.50	364.72	-	-
中信证券	2020110300000284	大富科技	2020-11-03	118,200.00	10,000.00	28	2.70	248.22	-	-
中信证券	2020110300000290	硕贝德	2020-11-03	390,880.00	28,000.00	28	3.60	1,094.46	-	-
中信证券	20201103000003142	光弘科技	2020-11-03	2,812,000.00	200,000.00	14	3.60	3,936.80	-	-
中信证券	20201106000027305	大富科技	2020-11-06	252,200.00	20,000.00	14	2.60	255.00	-	-
中信证券	20201106000027309	信维通信	2020-11-06	527,617.00	10,700.00	28	3.30	1,354.22	-	-
中信证券	20201106000027313	高新兴	2020-11-06	93,930.00	18,600.00	14	3.50	127.85	-	-
中信证券	20201106000027321	高新兴	2020-11-06	202,000.00	40,000.00	14	3.50	274.94	-	-
中信证券	20201106000027327	高新兴	2020-11-06	426,725.00	84,500.00	28	3.40	1,128.45	-	-
中信证券	20201106000027329	长盈精密	2020-11-06	588,336.00	23,800.00	28	3.20	1,464.30	-	-
中信证券	20201106000028309	天孚通信	2020-11-06	660,300.00	10,000.00	28	3.40	1,746.13	-	-
中	20201106000028	大	2020-11-	630,500.00	50,000.00	14	2.60	637.51	-	-

信 证 券	313	富 科 技	06							
中 信 证 券	2020110600028 317	新 易 盛	2020-11- 06	687,200.00	10,000.00	28	3.30	1,763.81	-	-
中 信 证 券	2020110600028 323	中 际 旭 创	2020-11- 06	527,000.00	10,000.00	28	3.30	1,352.63	-	-
中 信 证 券	2020110600028 705	飞 荣 达	2020-11- 06	229,800.00	10,000.00	14	3.30	294.91	-	-
中 信 证 券	2020110600028 707	光 弘 科 技	2020-11- 06	809,472.00	52,700.00	28	3.50	2,203.56	-	-
中 信 证 券	2020110600028 709	光 弘 科 技	2020-11- 06	772,608.00	50,300.00	28	3.50	2,103.21	-	-
中 信 证 券	2020110600028 711	飞 荣 达	2020-11- 06	1,608,600.0 0	70,000.00	28	3.20	4,003.63	-	-
中 信 证 券	2020110600028 713	光 弘 科 技	2020-11- 06	420,864.00	27,400.00	28	3.50	1,145.69	-	-
中 信 证 券	2020110600028 723	飞 荣 达	2020-11- 06	395,256.00	17,200.00	28	3.20	983.75	-	-
中 信 证 券	2020110600028 729	电 连 技 术	2020-11- 06	1,150,395.0 0	28,300.00	28	3.50	3,131.63	-	-
中 信 证 券	2020110600028 731	电 连 技 术	2020-11- 06	621,945.00	15,300.00	28	3.50	1,693.07	-	-
中 信	2020110600028 733	光 弘	2020-11- 06	256,512.00	16,700.00	14	3.60	359.12	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2020110600028 735	光 弘 科 技	2020-11- 06	192,000.00	12,500.00	14	3.60	268.80	-	-
中 信 证 券	2020110600028 737	光 弘 科 技	2020-11- 06	192,000.00	12,500.00	14	3.60	268.80	-	-
中 信 证 券	2020110600030 255	新 易 盛	2020-11- 06	1,236,960.0 0	18,000.00	14	3.40	1,635.54	-	-
中 信 证 券	2020110600030 257	飞 荣 达	2020-11- 06	2,298,000.0 0	100,000.0 0	14	3.30	2,949.10	-	-
中 信 证 券	2020110600030 263	天 孚 通 信	2020-11- 06	1,320,600.0 0	20,000.00	14	3.50	1,797.48	-	-
中 信 证 券	2020110600030 267	硕 贝 德	2020-11- 06	740,000.00	50,000.00	14	3.60	1,036.00	-	-
中 信 证 券	2020110600030 269	硕 贝 德	2020-11- 06	825,840.00	55,800.00	28	3.50	2,248.12	-	-
中 信 证 券	2020110600030 273	硕 贝 德	2020-11- 06	452,880.00	30,600.00	28	3.50	1,232.84	-	-
中 信 证 券	2020111000008 561	硕 贝 德	2020-11- 10	756,500.00	50,000.00	14	3.70	1,088.52	-	-
中 信 证 券	2020111000008 563	信 维 通 信	2020-11- 10	527,500.00	10,000.00	14	3.30	676.96	-	-
中 信 证 券	2020111000008 565	高 新 兴	2020-11- 10	105,336.00	20,900.00	14	3.70	151.57	-	-

券										
中信 证券	2020111000008 567	长 盈 精 密	2020-11- 10	360,503.00	14,300.00	14	3.40	476.67	-	-
中信 证券	2020111000008 569	光 弘 科 技	2020-11- 10	1,555,000.0 0	100,000.0 0	14	3.70	2,237.47	-	-
中信 证券	2020111000008 571	电 连 技 术	2020-11- 10	429,975.00	10,500.00	28	3.80	1,270.82	-	-
中信 证券	2020111000008 573	电 连 技 术	2020-11- 10	2,047,500.0 0	50,000.00	14	3.90	3,105.38	-	-
中信 证券	2020111000008 575	光 弘 科 技	2020-11- 10	715,300.00	46,000.00	14	3.70	1,029.24	-	-
中信 证券	2020111200004 089	电 连 技 术	2020-11- 12	419,685.00	10,500.00	14	3.90	636.52	-	-
中信 证券	2020111200004 091	硕 贝 德	2020-11- 12	255,606.00	17,400.00	14	3.70	367.79	-	-
中信 证券	2020111200004 101	天 孚 通 信	2020-11- 12	1,075,516.0 0	17,200.00	28	3.80	3,178.75	-	-
中信 证券	2020111200004 249	长 盈 精 密	2020-11- 12	248,000.00	10,000.00	14	3.40	327.91	-	-
中信 证券	2020111200004 251	大 富 科 技	2020-11- 12	477,414.00	37,800.00	28	2.70	1,002.57	-	-
中信 证券	2020111200004 253	新 易 盛	2020-11- 12	8,595,380.0 0	137,000.0 0	28	3.10	20,724.42	-	-

中信证券	2020111700000421	广和通	2020-11-17	553,100.00	10,000.00	14	4.00	860.38	-	-
中信证券	2020111700000425	新易盛	2020-11-17	662,200.00	11,000.00	14	4.40	1,133.10	-	-
中信证券	2020111700000429	中科创达	2020-11-17	2,170,220.00	22,100.00	14	3.60	3,038.31	-	-
中信证券	2020111700006101	光弘科技	2020-11-17	2,952,000.00	200,000.00	14	3.50	4,018.00	-	-
中信证券	2020111800004500	飞荣达	2020-11-18	3,319,500.00	150,000.00	28	3.40	8,778.23	-	-
中信证券	2020111900000355	长盈精密	2020-11-19	323,268.00	12,400.00	14	4.20	528.00	-	-
中信证券	2020112000020477	高新兴	2020-11-20	214,000.00	40,000.00	14	3.50	291.28	-	-
中信证券	2020112000020479	大富科技	2020-11-20	614,500.00	50,000.00	14	2.80	669.12	-	-
中信证券	2020112000022169	高新兴	2020-11-20	99,510.00	18,600.00	14	3.50	135.44	-	-
中信证券	2020112000022171	硕贝德	2020-11-20	718,000.00	50,000.00	14	3.70	1,033.12	-	-
中信证券	2020112000022173	飞荣达	2020-11-20	220,000.00	10,000.00	14	3.50	299.44	-	-
中	2020112000022	大	2020-11-	245,800.00	20,000.00	14	2.80	267.65	-	-

信 证 券	175	富 科 技	20							
中 信 证 券	2020112000022 177	新 易 盛	2020-11- 20	1,078,560.0 0	18,000.00	14	3.50	1,468.04	-	-
中 信 证 券	2020112000022 179	光 弘 科 技	2020-11- 20	244,989.00	16,700.00	14	3.50	333.46	-	-
中 信 证 券	2020112000022 181	光 弘 科 技	2020-11- 20	183,375.00	12,500.00	14	3.50	249.59	-	-
中 信 证 券	2020112000022 183	光 弘 科 技	2020-11- 20	183,375.00	12,500.00	14	3.50	249.59	-	-
中 信 证 券	2020112000022 185	天 孚 通 信	2020-11- 20	1,178,400.0 0	20,000.00	14	3.90	1,787.24	-	-
中 信 证 券	2020112400008 022	长 盈 精 密	2020-11- 24	269,850.00	10,500.00	28	4.10	860.52	-	-
中 信 证 券	2020112400008 024	光 弘 科 技	2020-11- 24	1,438,000.0 0	100,000.0 0	14	3.60	2,013.20	-	-
中 信 证 券	2020112400008 026	高 新 兴	2020-11- 24	110,352.00	20,900.00	14	6.70	287.53	-	-
中 信 证 券	2020112400008 028	硕 贝 德	2020-11- 24	716,000.00	50,000.00	14	3.70	1,030.24	-	-
中 信 证 券	2020112400008 038	电 连 技 术	2020-11- 24	1,910,000.0 0	50,000.00	14	3.50	2,599.72	-	-
中 信	2020112400008 040	光 弘	2020-11- 24	661,480.00	46,000.00	14	3.60	926.07	-	-

证 券		科 技								
中 信 证 券	2020112400008 042	长 盈 精 密	2020-11- 24	367,510.00	14,300.00	14	4.20	600.27	-	-
中 信 证 券	2020112400008 046	信 维 通 信	2020-11- 24	452,500.00	10,000.00	14	4.00	703.89	-	-
中 信 证 券	2020112600002 548	长 盈 精 密	2020-11- 26	257,100.00	10,000.00	14	4.20	419.93	-	-
中 信 证 券	2020120100002 813	中 科 创 达	2020-12- 01	1,953,419.0 0	22,100.00	14	3.70	2,810.75	-	-
中 信 证 券	2020120100002 819	新 易 盛	2020-12- 01	631,840.00	11,000.00	14	4.50	1,105.72	-	-
中 信 证 券	2020120100002 821	广 和 通	2020-12- 01	587,200.00	10,000.00	14	4.10	936.26	-	-
中 信 证 券	2020120300000 424	圣 邦 股 份	2020-12- 03	3,842,150.0 0	13,000.00	28	3.40	10,160.35	-	-
中 信 证 券	2020120300003 706	长 盈 精 密	2020-12- 03	329,096.00	12,400.00	14	4.10	524.73	-	-
中 信 证 券	2020120400004 784	大 富 科 技	2020-12- 04	242,600.00	20,000.00	14	3.30	311.34	-	-
中 信 证 券	2020120400004 786	大 富 科 技	2020-12- 04	606,500.00	50,000.00	14	3.30	778.34	-	-
中 信 证 券	2020120400005 256	天 孚 通	2020-12- 04	1,144,800.0 0	20,000.00	14	3.70	1,647.24	-	-

券		信								
中信 证券	2020120400005 258	新 易 盛	2020-12- 04	1,051,380.0 0	18,000.00	14	4.50	1,839.92	-	-
中信 证券	2020120400005 678	光 弘 科 技	2020-12- 04	760,033.00	50,300.00	28	3.50	1,868.76	-	1,868.7 6
中信 证券	2020120400005 680	光 弘 科 技	2020-12- 04	188,875.00	12,500.00	14	3.60	264.43	-	-
中信 证券	2020120400005 682	光 弘 科 技	2020-12- 04	252,337.00	16,700.00	14	3.60	353.27	-	-
中信 证券	2020120400005 684	光 弘 科 技	2020-12- 04	796,297.00	52,700.00	28	3.50	1,957.92	-	1,957.9 2
中信 证券	2020120400005 686	光 弘 科 技	2020-12- 04	188,875.00	12,500.00	14	3.60	264.43	-	-
中信 证券	2020120400005 688	硕 贝 德	2020-12- 04	710,000.00	50,000.00	14	3.60	994.00	-	-
中信 证券	2020120400005 690	电 连 技 术	2020-12- 04	1,058,703.0 0	28,300.00	28	3.50	2,603.11	-	2,603.1 1
中信 证券	2020120400005 692	硕 贝 德	2020-12- 04	792,360.00	55,800.00	28	3.50	1,948.24	-	1,948.2 4
中信 证券	2020120800000 422	信 维 通 信	2020-12- 08	536,040.00	12,000.00	28	3.80	1,301.39	430,56 0.00	1,301.3 9
中信 证券	2020120800004 922	信 维 通 信	2020-12- 08	446,700.00	10,000.00	14	3.60	625.38	-	-

中信证券	2020120800004924	长盈精密	2020-12-08	370,370.00	14,300.00	14	3.00	432.10	-	-
中信证券	2020120800004928	光弘科技	2020-12-08	672,520.00	46,000.00	14	3.60	941.53	-	-
中信证券	2020120800004930	电连技术	2020-12-08	1,869,500.00	50,000.00	14	3.60	2,617.30	-	-
中信证券	2020120800004932	电连技术	2020-12-08	392,595.00	10,500.00	28	3.50	877.89	356,685.00	877.89
中信证券	2020120800004934	光弘科技	2020-12-08	1,462,000.00	100,000.00	14	3.60	2,046.80	-	-
中信证券	2020120800004944	硕贝德	2020-12-08	710,500.00	50,000.00	14	3.60	994.70	-	-
中信证券	2020121000003826	大富科技	2020-12-10	439,992.00	37,800.00	28	3.20	821.32	390,474.00	821.32
中信证券	2020121000003832	新易盛	2020-12-10	7,866,540.00	137,000.00	28	3.50	16,060.85	7,600,760.00	16,060.85
中信证券	2020121000003834	天孚通信	2020-12-10	934,992.00	17,200.00	28	3.50	1,908.95	917,276.00	1,908.95
中信证券	2020121000003836	长盈精密	2020-12-10	246,400.00	10,000.00	14	3.00	287.47	-	-
中信证券	2020121500000535	蓝思科技	2020-12-15	930,900.00	30,000.00	14	3.80	1,375.66	-	-
中	2020121500000	光	2020-12-	277,600.00	20,000.00	28	4.40	542.86	273.00	542.86

信 证 券	552	弘 科 技	15						0.00	
中 信 证 券	2020121500000 563	长 盈 精 密	2020-12- 15	759,150.00	31,500.00	14	3.20	944.72	-	-
中 信 证 券	2020121500006 553	广 和 通	2020-12- 15	585,200.00	10,000.00	14	3.70	842.04	-	-
中 信 证 券	2020121500006 561	中 科 创 达	2020-12- 15	2,253,095.0 0	22,100.00	14	3.50	3,066.71	-	-
中 信 证 券	2020121500006 567	新 易 盛	2020-12- 15	615,560.00	11,000.00	14	4.20	1,005.41	-	-
中 信 证 券	2020121700001 480	新 易 盛	2020-12- 17	660,240.00	12,000.00	28	3.90	1,001.37	665,76 0.00	1,001.3 7
中 信 证 券	2020121700001 482	光 弘 科 技	2020-12- 17	266,000.00	20,000.00	28	4.40	455.16	273,00 0.00	455.16
中 信 证 券	2020121700010 313	长 盈 精 密	2020-12- 17	292,516.00	12,400.00	14	2.90	329.89	-	-
中 信 证 券	2020121800008 083	大 富 科 技	2020-12- 18	207,800.00	20,000.00	14	3.40	226.27	-	226.27
中 信 证 券	2020121800008 085	大 富 科 技	2020-12- 18	519,500.00	50,000.00	14	3.40	565.67	-	565.67
中 信 证 券	2020121800008 087	硕 贝 德	2020-12- 18	659,000.00	50,000.00	14	3.60	759.79	-	759.79
中 信	2020121800008 089	光 弘	2020-12- 18	164,375.00	12,500.00	14	4.50	236.90	-	236.90

证 券		科 技								
中 信 证 券	2020121800008 091	光 弘 科 技	2020-12- 18	219,605.00	16,700.00	14	4.50	316.49	-	316.49
中 信 证 券	2020121800008 093	光 弘 科 技	2020-12- 18	164,375.00	12,500.00	14	4.50	236.90	-	236.90
中 信 证 券	2020121800008 095	天 孚 通 信	2020-12- 18	1,062,400.0 0	20,000.00	14	4.50	1,531.11	-	1,531.1 1
中 信 证 券	2020121800008 097	新 易 盛	2020-12- 18	964,620.00	18,000.00	14	4.20	1,297.51	-	1,297.5 1
中 信 证 券	2020122200001 067	中 际 旭 创	2020-12- 22	517,000.00	10,000.00	28	3.70	478.22	508,60 0.00	478.22
中 信 证 券	2020122200010 409	电 连 技 术	2020-12- 22	1,671,000.0 0	50,000.00	14	4.70	1,963.43	1,698,5 00.00	1,963.4 3
中 信 证 券	2020122200010 411	光 弘 科 技	2020-12- 22	602,600.00	46,000.00	14	4.50	677.93	627,90 0.00	677.93
中 信 证 券	2020122200010 413	光 弘 科 技	2020-12- 22	1,310,000.0 0	100,000.0 0	14	4.50	1,473.75	1,365,0 00.00	1,473.7 5
中 信 证 券	2020122200010 415	信 维 通 信	2020-12- 22	381,600.00	10,000.00	14	3.90	372.06	358,80 0.00	372.06
中 信 证 券	2020122200010 417	长 盈 精 密	2020-12- 22	250,845.00	10,500.00	28	3.10	194.41	258,82 5.00	194.41
中 信 证 券	2020122200010 419	硕 贝 德	2020-12- 22	639,500.00	50,000.00	14	4.70	751.41	656,00 0.00	751.41

券										
中信证券	2020122200010421	长盈精密	2020-12-22	341,627.00	14,300.00	14	3.20	273.30	352,495.00	273.30
中信证券	2020122900000612	光弘科技	2020-12-29	137,100.00	10,000.00	14	3.30	25.14	136,500.00	25.14
中信证券	2020122900000616	蓝思科技	2020-12-29	920,700.00	30,000.00	14	4.20	214.83	918,300.00	214.83
中信证券	2020122900000622	硕贝德	2020-12-29	4,487,000.00	350,000.00	28	4.40	1,096.82	4,592,000.00	1,096.82
中信证券	2020122900000624	蓝思科技	2020-12-29	331,452.00	10,800.00	28	4.10	75.50	330,588.00	75.50
中信证券	20201229000007115	长盈精密	2020-12-29	740,250.00	31,500.00	14	3.50	143.94	776,475.00	143.94
中信证券	20201229000007117	中科创达	2020-12-29	2,313,649.00	22,100.00	14	3.50	449.88	2,585,700.00	449.88
中信证券	20201229000007119	蓝思科技	2020-12-29	920,700.00	30,000.00	14	3.20	163.68	918,300.00	163.68
中信证券	20201229000007121	广和通	2020-12-29	587,500.00	10,000.00	14	6.10	199.10	598,500.00	199.10
中信证券	2020123100000285	蓝思科技	2020-12-31	4,006,849.00	130,900.00	28	4.10	-	4,006,849.00	-
中信证券	2020123100000289	广和通	2020-12-31	598,500.00	10,000.00	14	4.50	-	598,500.00	-

中 信 证 券	2020123100010 612	长 盈 精 密	2020-12- 31	305,660.00	12,400.00	14	3.50	-	305,66 0.00	-
------------------	----------------------	------------------	----------------	------------	-----------	----	------	---	----------------	---

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
华夏中证 5G 通信 主题 ETF 联接	4,624,189,659.00	50.01%	7,092,770,459.00	40.22%
中信证券	2,757,284.00	0.03%	7,050,912.00	0.04%
中信中证资本	317,700.00	0.00%	-	-

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
中国银行活期存款	26,640,231.38	249,685.39	61,776,042.08	913,731.16

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

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	600941	中国移动	新股发行	124,803	7,186,156.74
中信证券	688235	百济神州	新股发行	19,217	3,701,194.20
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	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	301047	义翘神州	新股发行	500	146,460.00
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	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	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

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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
300308	中际旭创	2021-11-04	2022-05-05	非公开发行流通受限	31.00	40.41	1,129,032	34,999,992.00	45,624,183.12	-
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	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-07-05	新发流通受限	57.58	57.58	87,363	5,030,361.54	5,030,361.54	-
688235	百济神州	2021-12-06	2022-06-15	新发流通受限	192.60	136.46	19,217	3,701,194.20	2,622,351.82	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-01-05	新发流通受限	57.58	57.58	37,440	2,155,795.20	2,155,795.20	-

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	-
688499	利 元 亨	2021-06-23	2022-01-04	新发 流通 受限	38.85	293.00	2,149	83,488.65	629,657.00	-
688162	巨 一 科 技	2021-11-03	2022-05-10	新发 流通 受限	46.00	82.55	5,671	260,866.00	468,141.05	-
688767	博 拓 生 物	2021-09-01	2022-03-08	新发 流通 受限	34.55	66.38	2,220	76,701.00	147,363.60	-
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	-
688768	容 知 日 新	2021-07-16	2022-01-26	新发 流通 受限	18.23	108.54	907	16,534.61	98,445.78	-
301029	怡 合 达	2021-07-14	2022-01-24	新发 流	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-

				通 受 限						
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	2021-10-20	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	2021-06-23	2022-01-05	新发流	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-

	民			通 受 限						
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	新发流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
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	2021-11-25	2022-06-02	新发流	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-

	行			通 受 限						
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	-
301033	迈 普 医 学	2021-07-15	2022-01-26	新发 流通 受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
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	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-

				通 受 限						
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	002241	歌尔股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 13 日	54.10	1,777,300.00	96,151,930.00
2	002475	立讯精密	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 20 日	49.20	1,767,900.00	86,980,680.00
3	000063	中兴通讯	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 18 日	33.50	2,255,200.00	75,549,200.00
4	600745	闻泰科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	129.30	520,000.00	67,236,000.00
5	002179	中航光电	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	100.56	363,400.00	36,543,504.00
6	002463	沪电股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 20 日	16.58	2,019,100.00	33,476,678.00
7	002273	水晶光电	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 21 日	17.39	1,732,400.00	30,126,436.00
8	300413	芒果超媒	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 18 日	57.22	514,300.00	29,428,246.00
9	300383	光环新网	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 20 日	14.84	1,856,000.00	27,543,040.00
10	002600	领益智造	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 20 日	7.36	3,699,200.00	27,226,112.00
11	002456	欧菲光	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	9.70	2,662,000.00	25,821,400.00
12	300017	网宿科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	6.69	3,744,900.00	25,053,381.00
13	300136	信维通信	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 14 日	25.32	879,100.00	22,258,812.00
14	002555	三七互娱	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	27.02	815,400.00	22,032,108.00
15	300679	电连技术	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 25 日	52.50	392,100.00	20,585,250.00
16	300079	数码视讯	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 13 日	8.83	2,170,900.00	19,169,047.00
17	600498	烽火通信	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	17.98	978,700.00	17,597,026.00
18	300496	中科创达	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 25 日	138.42	117,400.00	16,250,508.00
19	002384	东山精密	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	27.10	576,100.00	15,612,310.00

20	300502	新易盛	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	39.18	385,000.00	15,084,300.00
21	002281	光迅科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	23.29	636,400.00	14,821,756.00
22	300166	东方国信	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	10.80	1,212,300.00	13,092,840.00
23	002123	梦网科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 18 日	17.20	732,800.00	12,604,160.00
24	002544	杰赛科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 13 日	23.74	504,800.00	11,983,952.00
25	300394	天孚通信	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 25 日	36.60	274,900.00	10,061,340.00
26	300308	中际旭创	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 20 日	42.50	228,200.00	9,698,500.00
27	601231	环旭电子	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	16.06	581,400.00	9,337,284.00
28	002138	顺络电子	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 13 日	38.18	223,200.00	8,521,776.00
29	603228	景旺电子	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 18 日	34.53	238,000.00	8,218,140.00
30	300735	光弘科技	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	15.07	509,300.00	7,675,151.00
31	300433	蓝思科技	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 14 日	22.98	309,700.00	7,116,906.00
32	603881	数据港	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	36.92	184,100.00	6,796,972.00
33	300638	广和通	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 14 日	54.50	119,900.00	6,534,550.00
34	300115	长盈精密	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 13 日	19.84	278,000.00	5,515,520.00
35	002916	深南电路	2022 年 1 月 11 日 -2022 年 1 月 11 日	121.82	32,000.00	3,898,240.00
36	300782	卓胜微	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 5 日	326.80	11,400.00	3,725,520.00
37	000988	华工科技	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 13 日	27.86	125,700.00	3,502,002.00
38	002396	星网锐捷	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 25 日	23.57	127,000.00	2,993,390.00
39	600845	宝信软件	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 25 日	60.83	48,000.00	2,919,840.00
40	002920	德赛西威	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 4 日	141.51	20,000.00	2,830,200.00
41	000938	紫光股份	2022 年 1 月 4 日 -2022 年 1 月 14 日	22.85	90,000.00	2,056,500.00

42	600703	三安光电	2022 年 1 月 14 日 -2022 年 1 月 14 日	37.56	52,000.00	1,953,120.00
43	603986	兆易创新	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 6 日	175.85	10,000.00	1,758,500.00
44	300661	圣邦股份	2022 年 1 月 3 日 -2022 年 1 月 14 日	309.00	4,700.00	1,452,300.00
45	601138	工业富联	2022 年 1 月 6 日 -2022 年 1 月 14 日	11.92	81,000.00	965,520.00
46	600183	生益科技	2022 年 1 月 14 日 -2022 年 1 月 14 日	23.55	30,000.00	706,500.00
合计					35,891,200.00	870,466,447.00

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内。

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 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	11,673,595,764.14	99.73	20,784,784,661.79	99.14
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	11,673,595,764.14	99.73	20,784,784,661.79	99.14

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	除中证 5G 通信主题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%	-581,278,629.87	-967,665,076.68
	+5%	581,278,629.87	967,665,076.68

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 11,596,506,019.32 元，第二层次的余额为 77,089,744.82 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 20,607,439,748.77 元，第二层次的余额为 177,344,913.02 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	11,673,595,764.14	99.38
	其中：股票	11,673,595,764.14	99.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	57,863,408.44	0.49
8	其他各项资产	14,884,857.56	0.13
9	合计	11,746,344,030.14	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 870,466,447.00 元, 占本基金期末资产净值的 7.44%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,235,270,002.58	87.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	47,434.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	1,155,981,886.58	9.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	40,329.16	0.00
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	282,199,144.24	2.41
S	综合	-	-
	合计	11,673,595,764.14	99.73

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	002475	立讯精密	27,925,509	1,373,935,042.80	11.74
2	002241	歌尔股份	15,769,403	853,124,702.30	7.29
3	000063	中兴通讯	20,950,282	701,834,447.00	6.00
4	600703	三安光电	17,730,412	665,954,274.72	5.69
5	600745	闻泰科技	4,939,480	637,948,764.00	5.45
6	603986	兆易创新	3,528,625	620,508,706.25	5.30
7	300782	卓胜微	1,545,683	505,129,204.40	4.32
8	002179	中航光电	3,622,262	364,254,666.72	3.11
9	300661	圣邦股份	1,096,525	338,826,225.00	2.89
10	601138	工业富联	26,217,076	312,507,545.92	2.67
11	300496	中科创达	2,239,561	310,000,033.62	2.65
12	300433	蓝思科技	13,126,690	301,651,336.20	2.58
13	300413	芒果超媒	4,931,680	282,190,729.60	2.41
14	002920	德赛西威	1,811,441	256,337,015.91	2.19
15	002384	东山精密	9,030,999	244,740,072.90	2.09
16	002555	三七互娱	8,775,176	237,105,255.52	2.03
17	000938	紫光股份	9,438,416	215,667,805.60	1.84
18	002938	鹏鼎控股	4,588,471	194,688,824.53	1.66
19	000988	华工科技	6,637,654	184,925,040.44	1.58
20	600183	生益科技	7,626,170	179,596,303.50	1.53
21	002138	顺络电子	4,256,906	162,528,671.08	1.39
22	300136	信维通信	6,376,870	161,462,348.40	1.38
23	002916	深南电路	1,286,338	156,701,695.16	1.34
24	300308	中际旭创	3,693,257	154,603,745.62	1.32
25	002463	沪电股份	8,754,200	145,144,636.00	1.24
26	603236	移远通信	679,912	138,634,056.80	1.18
27	002600	领益智造	18,646,681	137,239,572.16	1.17
28	600845	宝信软件	2,239,531	136,230,670.73	1.16
29	002273	水晶光电	7,334,015	127,538,520.85	1.09
30	002456	欧菲光	12,925,169	125,374,139.30	1.07
31	300383	光环新网	8,149,924	120,944,872.16	1.03
32	300115	长盈精密	5,544,109	109,995,122.56	0.94

33	300017	网宿科技	16,156,837	108,089,239.53	0.92
34	300502	新易盛	2,668,613	104,556,257.34	0.89
35	300679	电连技术	1,947,195	102,227,737.50	0.87
36	300079	数码视讯	9,431,486	83,280,021.38	0.71
37	600498	烽火通信	4,475,579	80,470,910.42	0.69
38	300638	广和通	1,360,962	74,172,429.00	0.63
39	002123	梦网科技	4,230,126	72,758,167.20	0.62
40	002396	星网锐捷	3,077,308	72,532,149.56	0.62
41	601231	环旭电子	4,380,469	70,350,332.14	0.60
42	002281	光迅科技	2,767,681	64,459,290.49	0.55
43	002544	杰赛科技	2,700,738	64,115,520.12	0.55
44	603228	景旺电子	1,678,940	57,973,798.20	0.50
45	300166	东方国信	5,329,613	57,559,820.40	0.49
46	300394	天孚通信	1,283,460	46,974,636.00	0.40
47	603881	数据港	1,091,407	40,294,746.44	0.34
48	002815	崇达技术	2,309,700	38,918,445.00	0.33
49	300735	光弘科技	2,564,206	38,642,584.42	0.33
50	002194	武汉凡谷	2,241,953	24,302,770.52	0.21
51	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	0.06
52	688235	百济神州	19,217	2,622,351.82	0.02
53	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.01
54	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.01
55	688499	利元亨	2,149	629,657.00	0.01
56	688162	巨一科技	5,671	468,141.05	0.00
57	688257	新锐股份	2,899	191,913.80	0.00
58	688767	博拓生物	2,220	147,363.60	0.00
59	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
60	688768	容知日新	907	98,445.78	0.00
61	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
62	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
63	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
64	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
65	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
66	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
67	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
68	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
69	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
70	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
71	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
72	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
73	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
74	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
75	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
76	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00

77	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
78	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
79	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
80	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
81	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
82	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
83	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
84	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
85	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
86	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
87	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
88	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
89	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
90	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
91	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
92	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
93	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
94	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
95	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
96	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
97	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
98	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
99	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
100	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
101	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
102	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
103	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
104	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
105	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
106	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
107	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
108	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
109	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
110	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
111	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
112	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	002475	立讯精密	1,305,205,031.92	6.23
2	600745	闻泰科技	814,314,834.39	3.88
3	000063	中兴通讯	750,911,108.12	3.58
4	300782	卓胜微	713,527,129.27	3.40
5	002241	歌尔股份	692,521,444.73	3.30
6	300413	芒果超媒	685,753,656.00	3.27
7	300433	蓝思科技	467,672,095.86	2.23
8	002555	三七互娱	461,275,108.02	2.20
9	300496	中科创达	347,154,083.64	1.66
10	002179	中航光电	297,323,031.65	1.42
11	300661	圣邦股份	252,456,485.33	1.20
12	000938	紫光股份	235,236,962.27	1.12
13	002938	鹏鼎控股	201,214,260.39	0.96
14	300308	中际旭创	200,719,742.64	0.96
15	002600	领益智造	196,770,065.49	0.94
16	002384	东山精密	192,572,936.37	0.92
17	002920	德赛西威	189,913,435.05	0.91
18	300017	网宿科技	185,353,435.81	0.88
19	002916	深南电路	175,896,811.24	0.84
20	300136	信维通信	174,622,461.94	0.83

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	002475	立讯精密	1,920,228,135.10	9.16
2	002241	歌尔股份	1,711,799,260.14	8.16
3	000063	中兴通讯	1,549,262,013.03	7.39
4	300782	卓胜微	1,183,436,039.66	5.64
5	002179	中航光电	766,994,978.30	3.66
6	300496	中科创达	729,784,232.14	3.48
7	300433	蓝思科技	718,712,577.27	3.43
8	000938	紫光股份	570,590,554.64	2.72
9	300661	圣邦股份	563,492,799.09	2.69
10	002938	鹏鼎控股	452,116,145.07	2.16
11	002384	东山精密	435,458,415.25	2.08
12	002600	领益智造	431,509,916.88	2.06
13	002138	顺络电子	384,419,314.46	1.83
14	300308	中际旭创	384,138,633.24	1.83
15	002916	深南电路	378,331,944.25	1.80
16	002456	欧菲光	376,520,313.80	1.80

17	300136	信维通信	363,979,800.72	1.74
18	002463	沪电股份	343,511,624.41	1.64
19	000988	华工科技	322,666,757.78	1.54
20	002273	水晶光电	298,837,270.77	1.43

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	11,222,595,978.51
卖出股票收入（成交）总额	18,753,208,819.66

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

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	4,445,987.43
2	应收证券清算款	10,007,133.53
3	应收股利	-
4	应收利息	431,736.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,884,857.56

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	002241	歌尔股份	96,151,930.00	0.82	转融通出借证券受限
2	002475	立讯精密	86,980,680.00	0.74	转融通出借证券受限
3	000063	中兴通讯	75,549,200.00	0.65	转融通出借证券受限
4	600745	闻泰科技	67,236,000.00	0.57	转融通出借证券受限
5	002179	中航光电	36,543,504.00	0.31	转融通出借证券受限
6	600745	闻泰科技	25,134,000.00	0.21	大宗转让流通受限
7	300782	卓胜微	3,725,520.00	0.03	转融通出借证券受限
8	600703	三安光电	1,953,120.00	0.02	转融通出借证券受限
9	603986	兆易创新	1,758,500.00	0.02	转融通出借证券受限
10	300661	圣邦股份	1,452,300.00	0.01	转融通出借证券受限
11	601138	工业富联	965,520.00	0.01	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。

9 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		华夏中证 5G 通信主题 ETF 联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
152,344	60,698.61	963,944,639.00	10.42%	3,658,934,178.00	39.57%	4,624,189,659.00	50.01%

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	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	165,000,000.00	1.78%
2	中国人寿保险股份有限公司（台湾）— 自有资金	162,520,596.00	1.76%
3	中国平安人寿保险股份有限公司—万 能一个险万能	83,492,400.00	0.90%
4	平安资产—工商银行—平安资产如意 20 号保险资产管理产品	54,390,200.00	0.59%
5	泰康资产丰选 FOF4 号股票型养老金 产品—中国工商银行股份有限公司	42,931,100.00	0.46%
6	中国人寿保险股份有限公司(台湾)— 自有资金	40,000,000.00	0.43%
7	光大理财有限责任公司—阳光橙增盈 稳健 3 号	36,533,700.00	0.40%
8	农银汇理资产—农业银行—农银汇理 资产—复合策略 5 号集合资产管理计 划	36,157,100.00	0.39%
9	姜辉	22,673,600.00	0.25%
10	华夏人寿保险股份有限公司—自有资 金	18,518,700.00	0.20%
11	中国银行股份有限公司—华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资 基金发起式联接基金	4,624,189,659.00	50.01%

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	43,900.00	0.00%

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 9 月 17 日)基金份额总额	4,152,568,476.00
本报告期期初基金份额总额	17,637,068,476.00
本报告期基金总申购份额	8,232,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,622,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,247,068,476.00

§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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 110,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 3 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	
中信证券	22	14,694,639,594.98	49.21%	6,337,827.00	49.21%	-
广发证券	1	6,059,799,414.58	20.30%	2,614,512.77	20.30%	-
申万宏源证券	4	2,349,025,815.64	7.87%	1,013,140.71	7.87%	-
华泰证券	4	1,788,855,184.22	5.99%	771,806.34	5.99%	-
海通证券	4	1,785,524,105.76	5.98%	770,099.84	5.98%	-
中信建投证券	3	1,744,302,807.01	5.84%	752,320.19	5.84%	-
中银国际证券	3	1,147,207,673.71	3.84%	494,792.54	3.84%	-
招商证券	3	81,099,733.77	0.27%	34,978.83	0.27%	-
长江证券	1	67,426,114.68	0.23%	29,080.78	0.23%	-
国信证券	3	51,041,422.78	0.17%	22,012.98	0.17%	-
方正证券	4	45,350,475.98	0.15%	19,559.30	0.15%	-
国盛证券	2	35,982,099.24	0.12%	15,518.90	0.12%	-
信达证券	1	8,268,345.73	0.03%	3,566.11	0.03%	-

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，本基金还选择了东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、国金证券、国泰君安证券、华安证券、华西证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、太平洋证券、万和证券、西部证券、兴业证券、野村东方国际、野村东方国际证券、粤开证券、中国银河证券、中金公司、中信建投证券、中信证券(浙江)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，中信证券的部分交易单元、中信建投证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，天风证券的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
中信证券	19,664,159.00	27.41%	40,000,000.00	100.00%
广发证券	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-
华泰证券	52,067,626.40	72.59%	-	-
海通证券	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-

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

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	2021-01-09
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	2021-01-15
4	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
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-27
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-01
7	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	2021-02-05
8	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	2021-02-09
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联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-07
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	中国证监会指定报刊及	2021-06-04

	关联方承销证券的公告	网站	
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联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-08-07
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	2021-08-10
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	2021-08-13
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	2021-10-13
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	2021-10-15
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	2021-10-20
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	2021-10-22
42	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
43	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
44	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	2021-11-06
45	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	2021-11-10

	关联方承销证券的公告	网站	
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	2021-11-22
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	2021-12-04
48	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
49	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
华夏中证5G通信主题ETF联接	1	2021-01-01至2021-12-31	7,092,770,459.00	1,883,000,000.00	4,351,580,800.00	4,624,189,659.00	50.01%
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、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证 5G 通信主题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