

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2023 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	20
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	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	24
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	24
§ 5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	24
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	24
§ 6 审计报告	24
6.1 审计报告的基本信息	25
6.2 审计报告的基本内容	25
§ 7 年度财务报表	26
7.1 资产负债表	27
7.2 利润表	28
7.3 净资产 (基金净值) 变动表	29
7.4 报表附注	31
§ 8 投资组合报告	171
8.1 期末基金资产组合情况	171
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	171
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	172

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	195
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	196
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.....	196
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.....	197
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.....	197
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.....	197
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	197
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	197
8.12 投资组合报告附注.....	197
§ 9 基金份额持有人信息.....	199
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	199
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	199
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	200
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.....	200
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	200
§ 10 开放式基金份额变动.....	200
§ 11 重大事件揭示.....	201
11.1 基金份额持有人大会决议.....	201
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.....	201
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	201
11.4 基金投资策略的改变.....	201
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	201
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.....	202
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	202
11.8 其他重大事件.....	203
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	205
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	205
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	205
§ 13 备查文件目录.....	205
13.1 备查文件目录.....	205
13.2 存放地点.....	205
13.3 查阅方式.....	205

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)	
基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF)	
基金主代码	501036	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 10 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额 (份)	394,815,027.56	
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	2017 年 10 月 09 日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	中证 500A	中证 500C
下属分级基金的交易代码	501036	501037
报告期末下属分级基金的份额总额 (份)	257,196,188.48	137,618,839.08

注：A 类份额扩位证券简称：中证 500LOF；C 类份额扩位证券简称：中证 500LOFC。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来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进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、固定收益类资产投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率 (税后)*5%

风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95565
传真	021-28932998	0755-82960794
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区 (东座) 6 楼 H686 室	深圳市福田区福华一路 111 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市福田区福华一路 111 号
邮政编码	200010	518000
法定代表人	李文	霍达

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网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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	2022 年	2021 年	2020 年
---------------	--------	--------	--------

和 指 标						
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	790,198.32	39,923.12	41,518,266 .69	23,283,677 .95	55,004,243 .66	27,092,274 .50
本期利润	- 48,527,803 .45	- 26,010,022 .76	38,618,346 .03	22,231,046 .42	71,868,477 .53	34,957,796 .62
加权平均基金份额本期利润	-0.2049	-0.2156	0.2147	0.2205	0.2544	0.2252
本期加权平均净值利润率	-17.97%	-19.11%	17.87%	18.53%	26.19%	23.38%
本期基金	-17.52%	-17.74%	20.61%	20.31%	27.99%	27.66%

份 额 净 值 增 长 率						
3.1 .2 期 末 数 据 和 指 标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	22,209,765 .21	10,036,535 .53	64,296,842 .87	31,972,194 .71	16,057,309 .50	9,711,147. 01
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	0.0864	0.0729	0.3172	0.3042	0.0851	0.0776
期 末 基 金 资 产 净 值	279,405,95 3.69	147,655,37 4.61	267,016,51 3.34	137,091,96 8.17	206,033,07 9.78	135,720,59 0.01

期末基金份额净值	1.0864	1.0729	1.3172	1.3042	1.0921	1.0840
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	8.64%	7.29%	31.72%	30.42%	9.21%	8.40%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

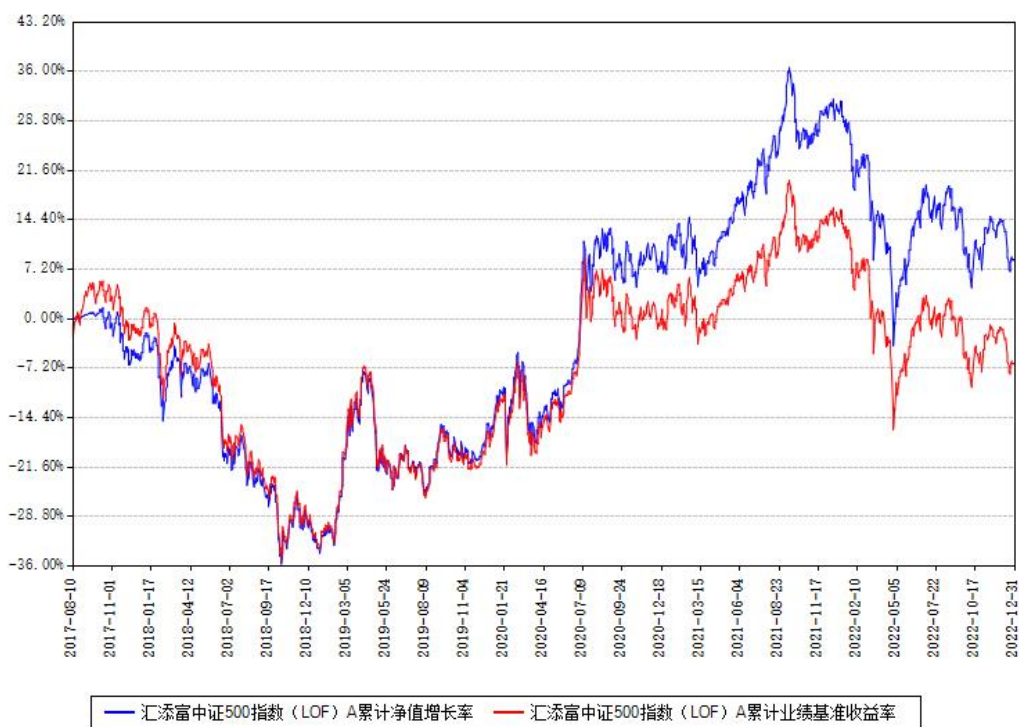
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证 500 指数 (LOF) A						
阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较基	业绩比较	①—③	②—④

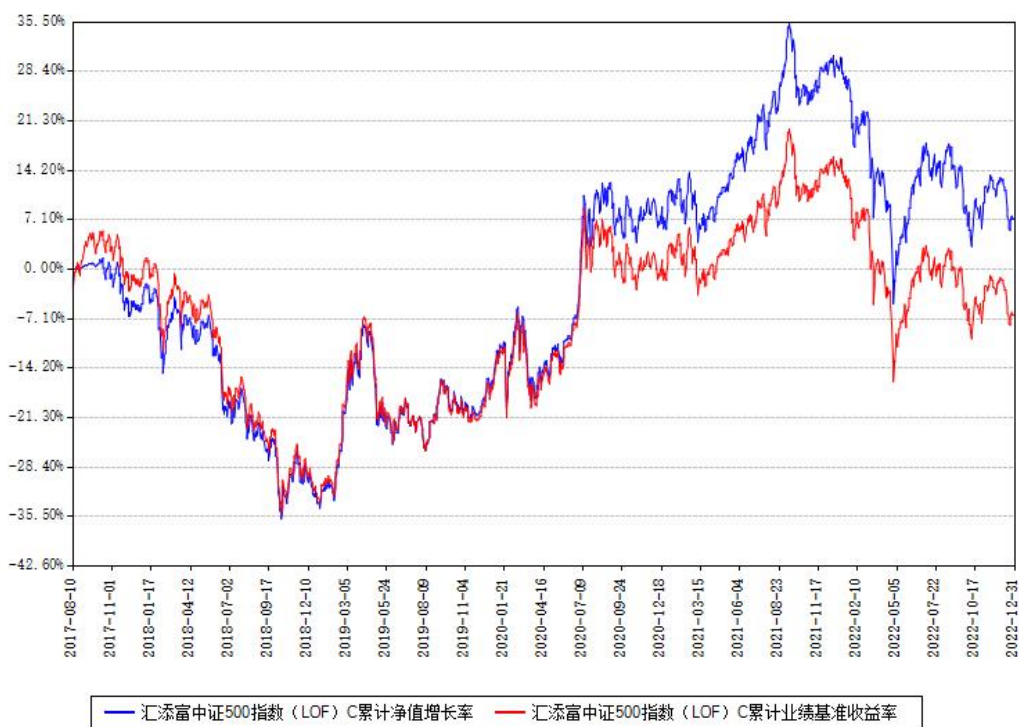
	长率①	增长率标准差②	准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	2.57%	0.96%	2.52%	0.97%	0.05%	-0.01%
过去六个月	-8.16%	1.03%	-8.66%	1.04%	0.50%	-0.01%
过去一年	-17.52%	1.29%	-19.30%	1.31%	1.78%	-0.02%
过去三年	27.32%	1.26%	11.15%	1.28%	16.17%	-0.02%
过去五年	14.26%	1.32%	-5.25%	1.34%	19.51%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	8.64%	1.28%	-6.49%	1.31%	15.13%	-0.03%
汇添富中证 500 指数 (LOF) C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.49%	0.96%	2.52%	0.97%	-0.03%	-0.01%
过去六个月	-8.28%	1.03%	-8.66%	1.04%	0.38%	-0.01%
过去一年	-17.74%	1.29%	-19.30%	1.31%	1.56%	-0.02%
过去三年	26.36%	1.26%	11.15%	1.28%	15.21%	-0.02%
过去五年	12.89%	1.32%	-5.25%	1.34%	18.14%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	7.29%	1.28%	-6.49%	1.31%	13.78%	-0.03%

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

汇添富中证500指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

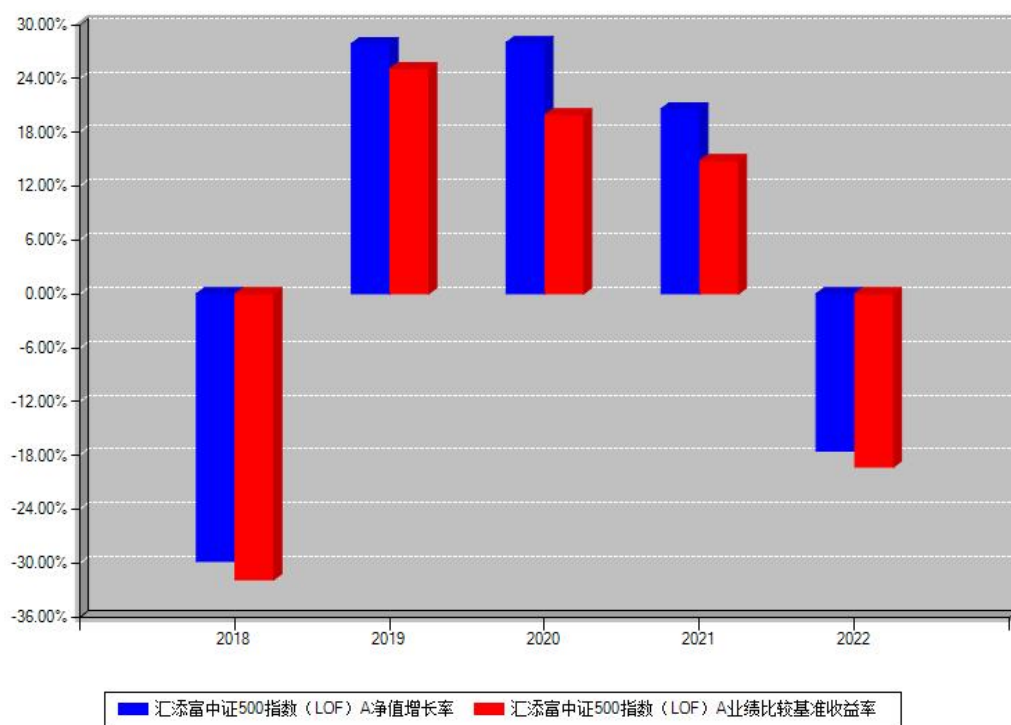


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2017年08月10日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

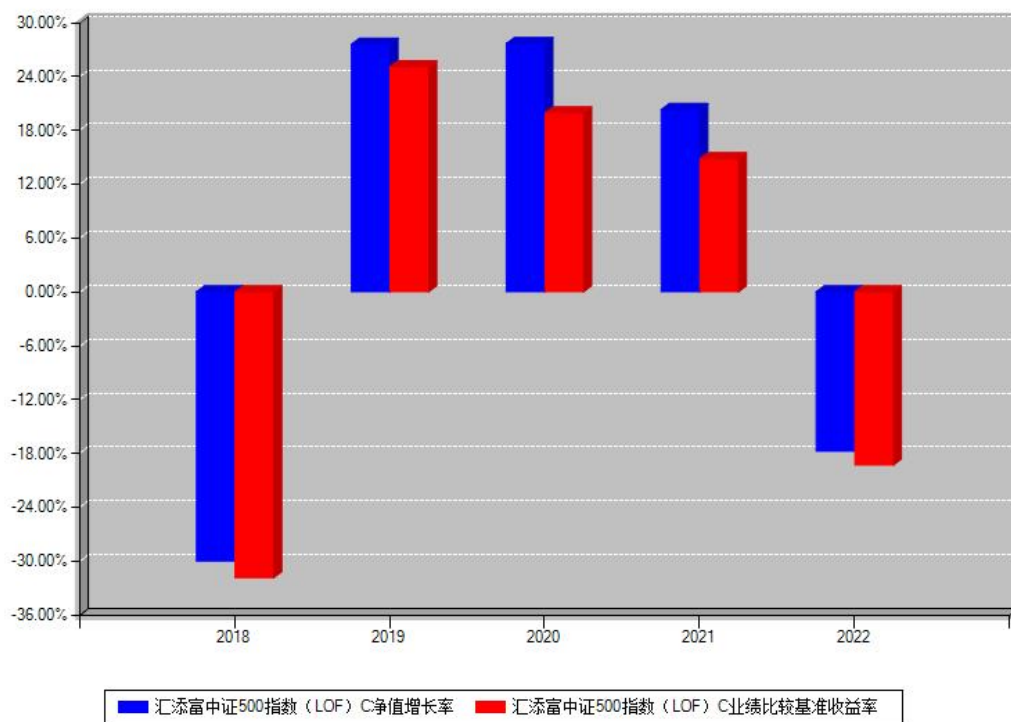
3.2.3 过去五年以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比

较

汇添富中证500指数（LOF）A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证500指数（LOF）C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为2017年08月10日，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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

§ 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理(美国)控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2022 年，汇添富基金新成立 45 只公募基金，包括 18 只混合型基金，17 只股票型基金，10 只债券型基金。2022 年底，公司公募基金产品总数达 270 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2022 年，汇添富基金继续坚持重度垂直兼顾开放的互联网金融平台战略，在不断夯实自有平台基础建设、全方位提升平台架构及安全系统的基础上，持续提升自有平台创新能力。从投资的生命周期各阶段出发，通过“渐进式”的创新和打磨，创造差异化的竞争优势。经过半年多的匠心打磨，推出了“指能添富”指数品牌以及对应的多项包括股债宝、指数热力地图、指数雷达等多个指数相关功能。继续深耕基于社区的大社交板块，涵盖视频、直播、资讯等各个维度，为客户架设可链接的投资及资讯服务桥梁。年内致力于基于买方视角，大力进行投顾服务转型，全方面提升客户投资的服务体验。全年自有平台精准营销体系初见成效，实现了平台活跃度的大幅提升，力争形成长期增长的良性循环。对外

合作上, 进一步加深与多家互联网巨头的深度战略合作, 继续大力开拓新型互联网销售及服务模式, 实现与平台的合作共赢。

2022 年, 汇添富基金持续深化落实机构客户战略, 机构业务规模保持较好的增长势头。公司为机构投资者提供综合解决方案, 并深受机构投资者信任。与银行及理财子公司合作深入, 保险委托管理规模同业领先。养老金业务方面, 公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格, 也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展, 受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设, 为客户及团队赋能。

2022 年是渠道业务模式和客户需求发生较大改变的一年, 公司始终秉持“客户第一”的价值观, 围绕如何提升客户“获得感”, 优化客户持有体验开展系列渠道服务和投资者教育工作。积极利用线上化数字营销工具, 对客户进行分类经营和分层触达, 建立精准的客户画像, 提供标准化、体系化、专业化的客户陪伴。同时搭建了一站式投研资讯服务平台, 提供紧贴市场的专业投资服务, 以及便捷高效的营销辅助工具, 赋能渠道客户经理。全年合计开展超 4000 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。持续大力开展目标收益定投、走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列客户活动, 营销培训活动覆盖至银行和券商的网点、营业部。

2022 年, 汇添富基金继续提升客户服务能力, 优化客户服务体系, 为公司各项销售业务提供全方位支持。同时, 持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设, 丰富服务渠道, 提升客户体验。

2022 年, 香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化, 并继续发挥显著成效, 国际业务总资产管理规模稳步进步。汇添富香港于开曼群岛设立联接基金架构下的两支子母基金, 汇添富权益大中华基金 (CUAM EQUITY GREATER CHINA FUND 和汇添富权益大中华主基金 (CUAM EQUITY GREATER CHINA MASTER FUND)。境外资产投资业绩稳健, 为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础, “中港策略”保持国际权威基金评级机构晨星五星评级, 港币债券基金荣获晨星 5 星评级。客户服务方面, 努力克服疫情影响, 积极通过线上路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外客户的持续沟通, 进一步完善个性化客户服务体系, 继续引导长期资金入市。

2022 年以来, 汇添富以爱能改变为任, 积极投身公益慈善, 履行社会责任。公司积极支持上海疫情防控, 支援街道、社区、医院和学校防疫工作; 继续为推动中西部欠发达地区教育发展和乡村振兴而不懈努力; 发挥公司专业优势, 发起“基业上善”慈善资产管理

研修营项目并完成第一期培训，助力国内公益基金会慈善资产保值增值和公益行业可持续发展。面对 2022 年上海爆发的疫情，公司在全力保护投资者利益、维护资本市场稳定的基础上，和全上海同呼吸共命运，支持一线抗疫，共同守“沪”。2022 年 3 月至 5 月，公司累计捐赠款物 107.77 万余元，用于“上海基金业致敬白衣天使”专项基金捐赠及瑞金医院、复旦大学、上海交通大学、以及部分街道社区抗疫物资捐赠。公司积极动员公司员工参与社区防疫服务工作，共有 77 人参与社区防疫志愿服务工作，超过员工总数 10%，服务总时长超过 2000 小时。在教育扶贫方面，汇添富持续开展“河流·孩子”公益助学计划：2022 年 1 月，通过“汇爱暖冬”联合捐赠行动，为全国 10 所添富小学筹集并捐赠价值近 400 万元的暖冬物资 20000 余份；2022 年 8 月，以线上形式开展第十五期“河流·孩子”2022 乡村优秀青年教师培训；2022 年 9 月，组织员工回访云南怒江州平安寨添富小学并提供支教等公益志愿服务。在乡村振兴方面，汇添富全年先后向黄浦区 2022 年党建助力对口支援地区乡村振兴项目、内蒙古兴和县产业帮扶和养老助老帮扶等项目、青海玛多县教育扶贫项目捐赠，助力乡村振兴。2022 年 12 月，在中国证券投资基金业协会及中国慈善联合会的指导和支持下，公司旗下上海汇添富公益基金会联合上海第一财经公益基金会发起并举办首期“基业上善”慈善资产管理研修营。汇添富基金发挥自身资产管理的专业能力，赋能公益事业的可持续发展，践行基金向善，助力共同富裕和社会进步。

2023 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2017 年 08 月 10 日		16	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管

				<p>理有限公司产品开发高级经理。</p> <p>2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司, 历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理, 现任指数与量化投资部副总监。</p> <p>2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2</p>
--	--	--	--	--

				<p>日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月 16 日至今任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗</p>
--	--	--	--	---

				<p>主题指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2018 年 3 月 23 日至今任汇添富沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的</p>
--	--	--	--	--

					基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至今任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

2、非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金

资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老保险组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。（2）在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。另外，公司还建立机制要求公募投资组合经理与资产管理计划投资组合经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。（3）在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。（4）在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范和流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3日内、5日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 41 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2022 年受内外部多重因素影响，国内 GDP 增长有所减速。结构上，消费和房地产对于经济增长有一定程度的拖累；而基建投资增速较高，对经济起到了较强的拉动作用。根据国家统计局数据，2022 年，资本形成总额对经济增长贡献率为 50.1%，拉动 GDP 增长 1.5 个百分点；最终消费支出对经济增长贡献率为 32.8%，拉动 GDP 增长 1.0 个百分点；货物和服务净出口对经济增长贡献率为 17.1%，拉动 GDP 增长 0.5 个百分点。

权益市场全年呈调整态势。风格方面，一、三季度市场整体调整，二季度市场反弹以成长风格为主导，而四季度在复苏预期下市场震荡企稳，风格偏向价值。行业方面，新能源景气度位于行业前列，成长性凸显，二季度涨幅居前；而消费、医药、科技等受益于复苏预期，四季度均有不错的表现。

报告期内，本基金遵循被动指数投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证 500 指数 (LOF) A 类份额净值增长率为-17.52%，同期业绩比较基准收益率为-19.30%。本报告期汇添富中证 500 指数 (LOF) C 类份额净值增长率为-17.74%，同期业绩比较基准收益率为-19.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

到 2022 年底，美联储加息、国际地缘冲突和国内消费疲软等多种因素影响逐渐弱化，展望 2023 年，经济阶段性低点或已过去，受益于稳增长和扩大内需的各项政策，经济或将迎来复苏。政策方面，中央经济工作会议要求把恢复和扩大消费摆在优先位置。会议提出要加大宏观政策调控力度，加强各类政策协调配合，形成共促高质量发展合力。财政政策要加力提效，货币政策要精准有力。流动性方面，国内流动性维持合理充裕。

海外方面，美国通胀数据有所好转，随着美联储加息接近尾声，海外流动性有望边际好转，同时人民币汇率逐渐稳定下来，由于境外资金对 A 股整体上仍是非常低配的状态，境外资金对 A 股有望重新回到流入状态。

在这样内外部改善的环境下，A 股市场也有望迎来盈利和估值的双重改善。

风险方面需要关注俄乌冲突可能的进一步扩大化。

作为被动投资的指数型基金，本基金将严格遵守基金合同，继续坚持既定的投资策略，积极采取有效方法去严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规法务管理

公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的公司价值观，完善合规管理体系，提升专业能力，优化合规资源配置，不断提升合规管理工作的有效性。公司坚持广泛开展合规培训、强化从业人员合规意识，不断夯实公司合规文化体系基础；持续完善公司制度流程体系、优化合规管理制度机制，通过统一的合规

审核标准、动态调整的合规管理指引,有效把控各类业务的合规关键点,防范潜在风险,保障各项业务规范开展;深入细致开展合规审查工作,为各部门提供有效的合规咨询与法务支持,督促强化一线合规执行效果;独立开展事后合规检查监督,查漏补缺、防微杜渐;优化从业人员管理机制,加强管理措施,严格执行合规考核问责机制,引导全体员工不断提升合规执业意识,强化公司合规履职保障。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前,加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性,为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外,本基金管理人坚持制度先行,通过制定或修订各项投资管理制度,为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中,管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等,有效保障投资交易行为合规。同时,通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示,完善日常投资合规风险监控体系。

事后,风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示,有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、加强稽核内审工作

通过开展日常风险排查,以及对重点业务开展专项稽核检查,尽早发现业务中存在的合规问题和风险隐患,并采取防范措施,督促责任部门落实整改;对风险事件和差错事件开展稽核审查,加强问责力度,促进业务合法合规开展;实施关键岗位离任审查,督促人员勤勉尽责、合规展业;配合监管检查与会计师事务所审计工作,通过问题反馈、实施整改,进一步完善公司内部控制管理机制。

通过上述工作,本报告期内,本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产,加强风险控制,持续提高监察稽核工作的科学性和有效性,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值,并保持估值政策

和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

无。

§ 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明 (2023) 审字第 60466941_B87 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报表, 包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表, 2022 年度的利润表、净资产 (基金净值) 变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为, 后附的汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF), 并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 管理层对其他信息负责。</p> <p>其他信息包括年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大错报, 我们应当报告该事实。在这方面, 我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表, 使其实现

<p>报表的责任</p>	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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：</p> <p>(1) 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。</p> <p>(2) 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。</p> <p>(3) 评价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。</p> <p>(4) 对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，就可能对汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）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汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）不能持续经营。</p> <p>(5) 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。</p> <p>我们与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。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>许培菁 韩云</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2023 年 03 月 31 日</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	23,910,410.75	23,719,024.89
结算备付金		5,793,342.16	8,101,772.97
存出保证金		1,151,715.37	1,666,597.68
交易性金融资产	7.4.7.2	396,763,584.76	371,264,731.69
其中：股票投资		393,096,493.34	371,126,184.49
基金投资		-	-
债券投资		3,667,091.42	138,547.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,395,745.54	2,151,364.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	14,255.12	20,747.72
资产总计		429,029,053.70	406,924,239.51
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		13.18	-
应付赎回款		1,411,087.61	2,184,614.79
应付管理人报酬		179,978.11	167,256.94

应付托管费		35,995.60	33,451.36
应付销售服务费		30,199.37	28,730.40
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,582.55	47,920.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	308,868.98	353,783.72
负债合计		1,967,725.40	2,815,758.00
净资产:			
实收基金	7.4.7.8	394,815,027.56	307,839,443.93
未分配利润	7.4.7.9	32,246,300.74	96,269,037.58
净资产合计		427,061,328.30	404,108,481.51
负债和净资产总计		429,029,053.70	406,924,239.51

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 394,815,027.56 份。本基金下属 A 类基金份额净值 1.0864 元，基金份额总额 257,196,188.48 份；本基金下属 C 类基金份额净值 1.0729 元，基金份额总额 137,618,839.08 份。

比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年末”余额。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-71,509,570.49	64,369,976.46
1. 利息收入		1,167,197.51	780,743.86
其中：存款利息收入	7.4.7.10	441,168.41	315,942.70
债券利息收入		-	173,671.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		726,029.10	291,129.95
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,645,553.58	67,480,043.67

其中：股票投资收益	7.4.7.11	-2,957,841.91	61,167,183.75
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	98,192.98	156,929.26
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-1,152,086.84	2,317,436.89
股利收益	7.4.7.17	6,657,289.35	3,838,493.77
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-75,367,947.65	-3,952,552.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	45,626.07	61,741.12
减：二、营业总支出		3,028,255.72	3,520,584.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,024,780.35	1,682,440.32
2. 托管费	7.4.10.2.2	404,956.00	336,488.00
3. 销售服务费		339,405.58	299,806.59
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		2,615.61	8,343.21
8. 其他费用	7.4.7.21	256,498.18	1,193,505.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-74,537,826.21	60,849,392.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-74,537,826.21	60,849,392.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-74,537,826.21	60,849,392.45

注：比较数据已根据本年《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〉》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF)

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	86,975,583.63	-64,022,736.84	22,952,846.79
(一)、综合收益总额	-	-74,537,826.21	-74,537,826.21
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	86,975,583.63	10,515,089.37	97,490,673.00
其中: 1. 基金申购款	465,926,882.29	63,153,977.84	529,080,860.13
2. 基金赎回款	-378,951,298.66	-52,638,888.47	-431,590,187.13
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	394,815,027.56	32,246,300.74	427,061,328.30
项目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	313,853,303.79	27,900,366.00	341,753,669.79
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净	313,853,303.79	27,900,366.00	341,753,669.79

资产 (基金净值)			
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-6,013,859.86	68,368,671.58	62,354,811.72
(一)、综合收益总额	-	60,849,392.45	60,849,392.45
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-6,013,859.86	7,519,279.13	1,505,419.27
其中: 1. 基金申购款	764,833,755.35	154,633,782.13	919,467,537.48
2. 基金赎回款	-770,847,615.21	-147,114,503.00	-917,962,118.21
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	307,839,443.93	96,269,037.58	404,108,481.51

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:

张暉	李骁	雷青松
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可[2017]770 号文《关于准予汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 注册的批复》准予注册, 由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2017 年 8 月 10 日生效。首次设立基金募集规模为 735,804,689.63 份基金份额, 业经安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙) 出具安永

华明 (2017) 验字第 60466941_B29 号验资报告予以验证。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司, 基金托管人为招商证券股份有限公司。

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, 基金还可投资于其他股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券 (包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券 (分离交易可转债)、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款 (包括定期存款、协议存款及其他银行存款)、货币市场工具、金融衍生工具 (包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等) 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 (但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为: 本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%, 其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%; 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。本基金进行被动式指数化投资, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为: 中证 500 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率 (税后) \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定 (统称“企业会计准则”) 编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项,本基金运用简化计量方法,按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产,本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加,如果信用风险自初始确认后未显著增加,处于第一阶段,本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果初始确认后发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照摊余成本和实际利率计算利息收入;

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础,通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况;

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息;

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产;

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察

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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际

持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等

有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

23,719,024.89 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 10,169.36 元, 重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后, 银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 23,729,194.25 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,101,772.97 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,975.61 元, 重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后, 结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,103,748.58 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,666,597.68 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 32.45 元, 重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后, 存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,666,630.13 元。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 6,759.14 元, 重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后, 其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,759.14 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,747.72 元, 转出至银行存款的重分类金额为人民币 10,169.36 元, 转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1,975.61 元, 转出至存出保证金的重分类金额为人民币 32.45 元, 转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 1,811.16 元, 转出至其他资产的重分类金额为人民币 6,759.14 元。经上述重分类后, 应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产:

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 371,264,731.69 元, 自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,811.16 元。经上述重分类后, 交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 371,266,542.85 元。

除上述财务报表项目外, 于首次执行日, 新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日, 新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》

的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得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，暂

减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	23,910,410.75	23,719,024.89
等于：本金	23,900,800.03	23,719,024.89
加：应计利息	9,610.72	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	23,910,410.75	23,719,024.89

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	436,283,380.75	-	393,096,493.34	43,186,887.41	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,613,740.00	63,881.42	3,667,091.42	-10,530.00
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	3,613,740.00	63,881.42	3,667,091.42	-10,530.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-	
合计	439,897,120.75	63,881.42	396,763,584.76	43,197,417.41	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	339,236,025.45	-	371,126,184.49	31,890,159.04	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	132,176.00	-	138,547.20	6,371.20
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	132,176.00	-	138,547.20	6,371.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	339,368,201.45	-	371,264,731.69	31,896,530.24	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	7,168,680.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	7,168,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	7,168,680.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
(国债期货投资)	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
(外汇期货投资)	-	-	-	-
权益衍生工具	9,846,080.00	-	-	-
(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	9,846,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,846,080.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2302	IC2302	6	7,055,520.00	-113,160.00
合计				-113,160.00
减：可抵销期货暂收款				-113,160.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额

为 0。

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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	20,747.72
其他应收款	14,255.12	-
待摊费用	-	-
合计	14,255.12	20,747.72

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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	-	-
应付交易费用	117,854.99	134,081.69
其中：交易所市场	117,854.99	134,081.69
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	50,000.00	80,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	21,013.99	19,702.03
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-

应付持有人大会费-律师费	-	-
其他	-	-
合计	308,868.98	353,783.72

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	202,719,670.47	202,719,670.47
本期申购	151,426,985.41	151,426,985.41
本期赎回 (以“-”号填列)	-96,950,467.40	-96,950,467.40
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	257,196,188.48	257,196,188.48
汇添富中证 500 指数 (LOF) C		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	105,119,773.46	105,119,773.46
本期申购	314,499,896.88	314,499,896.88
本期赎回 (以“-”号填列)	-282,000,831.26	-282,000,831.26
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	137,618,839.08	137,618,839.08

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证 500 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	65,785,363.91	-1,488,521.04	64,296,842.87
本期利润	790,198.32	-49,318,001.77	-48,527,803.45
本期基金份额交易产生的变动数	17,804,360.03	-11,363,634.24	6,440,725.79
其中：基金申购款	49,614,147.77	-28,819,256.73	20,794,891.04
基金赎回款	-31,809,787.74	17,455,622.49	-14,354,165.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	84,379,922.26	-62,170,157.05	22,209,765.21
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	32,789,050.93	-816,856.22	31,972,194.71
本期利润	39,923.12	-26,049,945.88	-26,010,022.76
本期基金份额交易产生的变动数	10,194,319.00	-6,119,955.42	4,074,363.58
其中：基金申购款	98,722,807.75	-56,363,720.95	42,359,086.80
基金赎回款	-88,528,488.75	50,243,765.53	-38,284,723.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,023,293.05	-32,986,757.52	10,036,535.53

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	339,437.31	199,616.57
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	98,676.82	105,391.36
其他	3,054.28	10,934.77
合计	441,168.41	315,942.70

注：“其他”为结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	153,752,319.30	310,436,392.81
减: 卖出股票成本总额	156,216,248.31	249,269,209.06
减: 交易费用	493,912.90	-
买卖股票差价收入	-2,957,841.91	61,167,183.75

7.4.7.11.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注: 本基金本报告期及上年度可比区间均无证券出借差价收入。

7.4.7.12 基金投资收益

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	44,512.11	-
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	53,680.87	156,929.26
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	98,192.98	156,929.26

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	354,076.16	12,048,159.54
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	297,676.00	11,653,436.90
减: 应计利息总额	2,709.07	237,793.38
减: 交易费用	10.22	-
买卖债券差价收入	53,680.87	156,929.26

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比区间均无衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-1,152,086.84	2,317,436.89
外汇远期投资收益	-	-
外汇期货投资收益	-	-
国债期货投资收益	-	-

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,657,289.35	3,838,493.77
其中：证券出借权益补偿收入	726,899.34	141,706.72
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,657,289.35	3,838,493.77

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-75,093,947.65	-4,010,272.19
——股票投资	-75,077,046.45	-3,884,765.05
——债券投资	-16,901.20	-125,507.14
——资产支持证券	-	-

投资		
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-274,000.00	57,720.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-274,000.00	57,720.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品 公允价值变动产生的 预估增值税	-	-
合计	-75,367,947.65	-3,952,552.19

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	45,626.07	61,741.12
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	45,626.07	61,741.12

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	5,407.58	9,838.41
指数使用费	80,991.17	67,297.57
持有人大会- 公证费	-	-
持有人大会- 律师费	-	-
开户费	-	-
上市费	-	-

其他	99.43	916,369.91
合计	256,498.18	1,193,505.89

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金发起人
招商证券股份有限公司 (“招商证券”)	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

注：以下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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 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 (%)
招商证券	400,108,476.62	100.00	607,953,137.49	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 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 (%)
招商证券	3,855,220.16	100.00	17,752,362.92	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 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 (%)
招商证券	287,960.91	100.00	117,854.99	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 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 (%)
招商证券	528,702.12	100.00	134,081.69	100.00

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,024,780.35	1,682,440.32
其中：支付销售机构的客户维护费	600,071.64	467,665.03

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	404,956.00	336,488.00

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份	-	325.40	325.40

有限公司			
东方证券股份有限公司	-	12,697.28	12,697.28
汇添富基金管理股份有限公司	-	61,139.36	61,139.36
合计	-	74,162.04	74,162.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	合计
招商证券股份有限公司	-	301.34	301.34
东方证券股份有限公司	-	14,869.56	14,869.56
汇添富基金管理股份有限公司	-	48,301.83	48,301.83
合计	-	63,472.73	63,472.73

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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 2022 年 01 月 01 日至 2022 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
东方证券	40,650,341.00	28,022.92	469,650.00	113.99
招商证券	5,017,204.00	3,345.08	-	-
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 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
招商证券	-	-	-	-

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 2022 年 01 月 01 日至 2022 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
东方证券	2022011100000695	微芯生物	2022年01月11日	134,082.00	3,900.00	14	3.60	187.71	-	-
东方证券	2022011100000697	圣湘生物	2022年01月	66,100.00	1,000.00	14	3.60	92.54	-	-

			月 11 日							
东方 证 券	20220125000118 80	圣 湘 生 物	202 2 年 01 月 25 日	52,310.00	1,000.00	14	3.6 0	73.23	-	-
东方 证 券	20220125000118 90	微 芯 生 物	202 2 年 01 月 25 日	125,307.0 0	3,900.00	14	3.6 0	175.4 3	-	-
东方 证 券	20220208000152 72	微 芯 生 物	202 2 年 02 月 08 日	117,234.0 0	3,900.00	14	3.6 0	164.1 3	-	-
东方 证 券	20220208000152 76	圣 湘 生 物	202 2 年 02 月 08 日	51,310.00	1,000.00	14	3.6 0	71.83	-	-
东方 证 券	20220222000137 03	微 芯 生 物	202 2 年 02 月 22 日	114,855.0 0	3,900.00	14	3.6 0	160.8 0	-	-
东方 证 券	20220307000013 23	三 聚 环 保	202 2 年 03 月 07	7,400.00	1,000.00	14	3.4 0	9.78	-	-

			日							
招商证券	2022030700001331	捷成股份	2022年03月07日	27,888.00	4,800.00	14	4.00	43.38	-	-
招商证券	2022030700001337	碧水源	2022年03月07日	242,298.00	37,800.00	14	4.00	376.91	-	-
东方证券	2022032100000740	昆仑万维	2022年03月21日	16,550.00	1,000.00	14	3.40	25.01	-	-
东方证券	2022032100000741	景嘉微	2022年03月21日	108,000.00	1,000.00	14	3.40	163.20	-	-
东方证券	2022032100000746	卫宁健康	2022年03月21日	9,600.00	1,000.00	14	3.40	14.51	-	-
东方证券	2022032100000749	长盈精密	2022年03月21日	10,530.00	1,000.00	14	3.40	15.91	-	-
东	20220321000007	中	202	33,780.00	1,000.00	14	3.4	51.05	-	-

方证券	52	际旭创	2 年 03 月 21 日				0			
东方证券	20220321000007 54	网宿科技	202 2 年 03 月 21 日	6,000.00	1,000.00	14	3.4 0	9.07	-	-
东方证券	20220321000007 58	国瓷材料	202 2 年 03 月 21 日	34,250.00	1,000.00	14	3.4 0	51.76	-	-
东方证券	20220321000007 60	信维通信	202 2 年 03 月 21 日	18,700.00	1,000.00	14	3.4 0	28.26	-	-
招商证券	20220321000007 61	万孚生物	202 2 年 03 月 21 日	295,434.0 0	5,400.00	14	4.0 0	525.2 2	-	-
东方证券	20220321000007 62	利亚德	202 2 年 03 月 21 日	7,540.00	1,000.00	14	3.4 0	11.39	-	-
东方证	20220321000007 64	光线传	202 2 年	8,030.00	1,000.00	14	3.4 0	12.13	-	-

券		媒	03 月 21 日							
东方证 券	20220321000007 66	普 利 制 药	202 2 年 03 月 21 日	44,370.00	1,000.00	14	3.4 0	67.05	-	-
东方证 券	20220321000007 69	万 达 信 息	202 2 年 03 月 21 日	11,260.00	1,000.00	14	3.4 0	17.02	-	-
东方证 券	20220321000288 97	三 聚 环 保	202 2 年 03 月 21 日	6,680.00	1,000.00	14	3.4 0	10.09	-	-
招商证 券	20220321000332 21	碧 水 源	202 2 年 03 月 21 日	224,910.0 0	37,800.0 0	14	4.0 0	399.8 4	-	-
招商证 券	20220328000003 36	康 泰 医 学	202 2 年 03 月 28 日	71,694.00	2,100.00	14	3.6 0	100.3 7	-	-
招商证 券	20220328000003 38	碧 水 源	202 2 年 03 月	6,435.00	1,100.00	14	3.6 0	9.01	-	-

			28 日							
东方证 券	20220406000522 83	三 聚 环 保	202 2 年 04 月 06 日	6,540.00	1,000.00	14	3.4 0	8.65	-	-
东方证 券	20220406000602 61	景 嘉 微	202 2 年 04 月 06 日	92,270.00	1,000.00	14	3.4 0	122.0 0	-	-
东方证 券	20220406000602 67	普 利 制 药	202 2 年 04 月 06 日	43,210.00	1,000.00	14	3.4 0	57.13	-	-
东方证 券	20220406000602 71	万 达 信 息	202 2 年 04 月 06 日	10,750.00	1,000.00	14	3.4 0	14.21	-	-
东方证 券	20220406000602 73	卫 宁 健 康	202 2 年 04 月 06 日	9,510.00	1,000.00	14	3.4 0	12.57	-	-
东方证 券	20220406000602 77	昆 仑 万 维	202 2 年 04 月 06 日	17,420.00	1,000.00	14	3.4 0	23.03	-	-

东方证券	2022040600060283	国瓷材料	2022年04月06日	34,710.00	1,000.00	14	3.40	45.89	-	-
东方证券	2022040600060289	长盈精密	2022年04月06日	9,670.00	1,000.00	14	3.40	12.79	-	-
东方证券	2022040600060295	网宿科技	2022年04月06日	5,920.00	1,000.00	14	3.40	7.83	-	-
东方证券	2022040600060299	光线传媒	2022年04月06日	8,200.00	1,000.00	14	3.40	10.84	-	-
招商证券	2022040600060863	碧水源	2022年04月06日	229,824.00	37,800.00	14	4.00	357.50	-	-
招商证券	2022040600060867	万孚生物	2022年04月06日	265,356.00	5,400.00	14	4.00	412.78	-	-
东方	2022040600066187	信维	2022	17,710.00	1,000.00	14	3.40	23.42	-	-

证券		通信	年 04 月 06 日							
东方证券	20220406000662 01	利亚德	202 2 年 04 月 06 日	7,150.00	1,000.00	14	3.4 0	9.45	-	-
东方证券	20220406000662 03	中际旭创	202 2 年 04 月 06 日	30,100.00	1,000.00	14	3.4 0	39.80	-	-
招商证券	20220411000008 49	万达信息	202 2 年 04 月 11 日	190,617.0 0	20,300.0 0	14	3.6 0	266.8 6	-	-
东方证券	20220420000430 90	中际旭创	202 2 年 04 月 20 日	29,930.00	1,000.00	14	3.4 0	42.40	-	-
东方证券	20220420000431 18	景嘉微	202 2 年 04 月 20 日	87,100.00	1,000.00	14	3.4 0	123.3 9	-	-
东方证券	20220420000431 20	万达信息	202 2 年 04 月	9,320.00	1,000.00	14	3.4 0	13.20	-	-

			月 20 日							
东方 证 券	20220420000431 24	卫 宁 健 康	202 2 年 04 月 20 日	8,130.00	1,000.00	14	3.4 0	11.52	-	-
东方 证 券	20220420000431 30	利 亚 德	202 2 年 04 月 20 日	6,610.00	1,000.00	14	3.4 0	9.36	-	-
东方 证 券	20220420000437 66	昆 仑 万 维	202 2 年 04 月 20 日	15,030.00	1,000.00	14	3.4 0	21.29	-	-
东方 证 券	20220420000450 02	三 聚 环 保	202 2 年 04 月 20 日	5,900.00	1,000.00	14	3.4 0	8.36	-	-
东方 证 券	20220420000450 08	光 线 传 媒	202 2 年 04 月 20 日	8,000.00	1,000.00	14	3.4 0	11.33	-	-
东方 证 券	20220420000450 12	网 宿 科 技	202 2 年 04 月 20	5,380.00	1,000.00	14	3.4 0	7.62	-	-

			日							
东方证券	2022042000045016	国瓷材料	2022年04月20日	32,120.00	1,000.00	14	3.40	45.50	-	-
东方证券	2022042000045020	信维通信	2022年04月20日	16,070.00	1,000.00	14	3.40	22.77	-	-
东方证券	2022042000045022	长盈精密	2022年04月20日	8,460.00	1,000.00	14	3.40	11.99	-	-
东方证券	2022042000045036	普利制药	2022年04月20日	27,710.00	1,000.00	14	3.40	39.26	-	-
招商证券	2022042000045168	万孚生物	2022年04月20日	245,160.00	5,400.00	14	4.00	408.60	-	-
招商证券	2022042000046942	碧水源	2022年04月20日	193,914.00	37,800.00	14	4.00	323.19	-	-
东	20220425000005	碧	202	9,260.00	2,000.00	14	3.4	12.24	-	-

方证券	72	水源	2 年 04 月 25 日				0			
招商证券	20220425000060 17	万达信息	202 2 年 04 月 25 日	159,558.0 0	20,300.0 0	14	3.6 0	223.3 8	-	-
东方证券	20220505000631 95	中际旭创	202 2 年 05 月 05 日	31,910.00	1,000.00	14	3.4 0	42.19	-	-
东方证券	20220505000632 03	万达信息	202 2 年 05 月 05 日	8,180.00	1,000.00	14	3.4 0	10.82	-	-
东方证券	20220505000632 07	景嘉微	202 2 年 05 月 05 日	83,050.00	1,000.00	14	3.4 0	109.8 1	-	-
东方证券	20220505000632 09	利亚德	202 2 年 05 月 05 日	6,000.00	1,000.00	14	3.4 0	7.93	-	-
东方证	20220505000632 17	昆仑万	202 2 年	14,570.00	1,000.00	14	3.4 0	19.26	-	-

券		维	05 月 05 日							
东方证 券	20220505000632 25	光 线 传 媒	202 2 年 05 月 05 日	7,000.00	1,000.00	14	3.4 0	9.26	-	-
东方证 券	20220505000632 31	卫 宁 健 康	202 2 年 05 月 05 日	8,090.00	1,000.00	14	3.4 0	10.70	-	-
东方证 券	20220505000644 63	普 利 制 药	202 2 年 05 月 05 日	26,740.00	1,000.00	14	3.4 0	35.36	-	-
东方证 券	20220505000644 83	网 宿 科 技	202 2 年 05 月 05 日	4,830.00	1,000.00	14	3.4 0	6.39	-	-
东方证 券	20220505000644 93	三 聚 环 保	202 2 年 05 月 05 日	4,250.00	1,000.00	14	3.4 0	5.62	-	-
东方证 券	20220505000645 07	国 瓷 材 料	202 2 年 05 月	32,290.00	1,000.00	14	3.4 0	42.69	-	-

			05 日							
招商 证券	20220505000648 77	碧 水 源	202 2 年 05 月 05 日	175,014.0 0	37,800.0 0	14	4.0 0	272.2 4	-	-
招商 证券	20220505000648 87	万 孚 生 物	202 2 年 05 月 05 日	246,402.0 0	5,400.00	14	4.0 0	383.2 9	-	-
东方 证券	20220505000734 35	信 维 通 信	202 2 年 05 月 05 日	14,960.00	1,000.00	14	3.4 0	19.78	-	-
东方 证券	20220505000734 37	长 盈 精 密	202 2 年 05 月 05 日	7,760.00	1,000.00	14	3.4 0	10.26	-	-
东方 证券	20220509000007 54	迈 为 股 份	202 2 年 05 月 09 日	485,400.0 0	1,500.00	14	3.4 0	641.8 1	-	-
东方 证券	20220509000007 56	景 嘉 微	202 2 年 05 月 09 日	154,422.0 0	1,800.00	14	3.4 0	204.1 8	-	-

东方证券	2022050900000762	利亚德	2022年05月09日	11,800.00	2,000.00	14	3.40	15.60	-	-
东方证券	2022050900000764	昆仑万维	2022年05月09日	28,640.00	2,000.00	14	3.40	37.87	-	-
东方证券	2022050900000766	信维通信	2022年05月09日	29,800.00	2,000.00	14	3.40	39.40	-	-
东方证券	2022050900000770	长盈精密	2022年05月09日	14,940.00	2,000.00	14	3.40	19.75	-	-
东方证券	2022050900000772	长信科技	2022年05月09日	11,820.00	2,000.00	14	3.40	15.63	-	-
东方证券	2022050900000774	国瓷材料	2022年05月09日	62,800.00	2,000.00	14	3.40	83.04	-	-
东方	2022050900000776	卫宁	2022	16,180.00	2,000.00	14	3.40	21.39	-	-

证券		健康	年 05 月 09 日							
东方证券	2022050900000778	光线传媒	2022年 05月 09日	13,680.00	2,000.00	14	3.40	18.09	-	-
东方证券	2022050900010249	碧水源	2022年 05月 09日	9,340.00	2,000.00	14	3.40	12.35	-	-
东方证券	2022051900041549	三聚环保	2022年 05月 19日	4,650.00	1,000.00	14	3.40	6.15	-	-
东方证券	2022051900041555	网宿科技	2022年 05月 19日	5,120.00	1,000.00	14	3.40	6.77	-	-
东方证券	2022051900041561	光线传媒	2022年 05月 19日	7,120.00	1,000.00	14	3.40	9.41	-	-
东方证券	2022051900043657	景嘉微	2022年 05月	91,650.00	1,000.00	14	3.40	121.18	-	-

			月 19 日							
东方 证券	20220519000436 71	中 际 旭 创	202 2 年 05 月 19 日	31,180.00	1,000.00	14	3.4 0	41.23	-	-
东方 证券	20220519000436 91	卫 宁 健 康	202 2 年 05 月 19 日	8,270.00	1,000.00	14	3.4 0	10.93	-	-
东方 证券	20220519000436 97	昆 仑 万 维	202 2 年 05 月 19 日	14,720.00	1,000.00	14	3.4 0	19.46	-	-
东方 证券	20220519000437 09	信 维 通 信	202 2 年 05 月 19 日	15,590.00	1,000.00	14	3.4 0	20.61	-	-
东方 证券	20220519000440 45	利 亚 德	202 2 年 05 月 19 日	6,170.00	1,000.00	14	3.4 0	8.16	-	-
东方 证券	20220519000440 51	普 利 制 药	202 2 年 05 月 19 日	26,920.00	1,000.00	14	3.4 0	35.59	-	-

			日							
东方证券	2022051900044057	长盈精密	2022年05月19日	8,470.00	1,000.00	14	3.40	11.20	-	-
东方证券	2022051900044071	国瓷材料	2022年05月19日	33,180.00	1,000.00	14	3.40	43.87	-	-
招商证券	2022051900044425	碧水源	2022年05月19日	181,440.00	37,800.00	14	4.00	282.24	-	-
招商证券	2022051900045015	万孚生物	2022年05月19日	220,914.00	5,400.00	14	4.00	343.64	-	-
东方证券	2022052300000619	中际旭创	2022年05月23日	62,960.00	2,000.00	14	3.40	83.25	-	-
东方证券	20220523000006783	光线传媒	2022年05月23日	14,840.00	2,000.00	14	3.40	19.62	-	-
东	202205230000068	碧	202	9,780.00	2,000.00	14	3.4	12.93	-	-

方证券	01	水源	2 年 05 月 23 日				0			
东方证券	20220523000068 17	长信科技	202 2 年 05 月 23 日	13,560.00	2,000.00	14	3.4 0	17.93	-	-
东方证券	20220523000068 43	利亚德	202 2 年 05 月 23 日	12,520.00	2,000.00	14	3.4 0	16.55	-	-
东方证券	20220523000068 49	长盈精密	202 2 年 05 月 23 日	17,160.00	2,000.00	14	3.4 0	22.69	-	-
东方证券	20220523000068 55	迈为股份	202 2 年 05 月 23 日	562,200.0 0	1,500.00	14	3.4 0	743.3 5	-	-
东方证券	20220523000068 65	昆仑万维	202 2 年 05 月 23 日	30,000.00	2,000.00	14	3.4 0	39.67	-	-
东方证	20220523000068 69	国瓷材	202 2 年	66,740.00	2,000.00	14	3.4 0	88.25	-	-

券		料	05 月 23 日							
东方证 券	20220523000069 29	景嘉 微	202 2 年 05 月 23 日	165,672.0 0	1,800.00	14	3.4 0	219.0 6	-	-
东方证 券	20220523000069 45	卫宁 健康	202 2 年 05 月 23 日	17,340.00	2,000.00	14	3.4 0	22.93	-	-
东方证 券	20220523000069 53	信维 通信	202 2 年 05 月 23 日	31,540.00	2,000.00	14	3.4 0	41.70	-	-
东方证 券	20220613000033 76	万孚 生物	202 2 年 06 月 13 日	80,100.00	2,000.00	14	3.4 0	105.9 1	-	-
东方证 券	20220613000033 78	中际 旭创	202 2 年 06 月 13 日	65,600.00	2,000.00	14	3.4 0	86.74	-	-
东方证 券	20220613000033 80	开山 股份	202 2 年 06 月	29,340.00	2,000.00	14	3.4 0	38.79	-	-

			13 日							
东方证 券	20220613000033 82	易华 录	202 2年 06月 13日	33,480.00	2,000.00	14	3.4 0	44.27	-	-
东方证 券	20220613000033 84	万达信 息	202 2年 06月 13日	18,160.00	2,000.00	14	3.4 0	24.01	-	-
东方证 券	20220613000033 86	三聚环 保	202 2年 06月 13日	9,520.00	2,000.00	14	3.4 0	12.59	-	-
东方证 券	20220613000033 90	机器 人	202 2年 06月 13日	16,940.00	2,000.00	14	3.4 0	22.40	-	-
东方证 券	20220613000033 92	网宿科 技	202 2年 06月 13日	10,360.00	2,000.00	14	3.4 0	13.70	-	-
东方证 券	20220613000033 94	华测 检测	202 2年 06月 13日	44,940.00	2,000.00	14	3.4 0	59.42	-	-

东方 证券	20220613000033 96	稳健 医疗	202 2 年 06 月 13 日	64,780.00	1,000.00	14	3.4 0	85.65	-	-
东方 证券	20220613000033 98	光威 复材	202 2 年 06 月 13 日	113,580.0 0	2,000.00	14	3.4 0	150.1 8	-	-
东方 证券	20220620000014 62	机器 人	202 2 年 06 月 20 日	18,100.00	2,000.00	14	3.4 0	23.93	-	-
东方 证券	20220620000014 64	易华 录	202 2 年 06 月 20 日	32,414.00	1,900.00	14	3.4 0	42.86	-	-
东方 证券	20220620000014 66	网宿 科技	202 2 年 06 月 20 日	10,640.00	2,000.00	14	3.4 0	14.07	-	-
东方 证券	20220620000014 68	华测 检测	202 2 年 06 月 20 日	44,400.00	2,000.00	14	3.4 0	58.71	-	-
东 方	20220620000014 70	稳健	202 2	83,239.00	1,300.00	14	3.4 0	110.0 6	-	-

证券		医疗	年 06 月 20 日							
东方证券	20220620000014 72	中际旭创	202 2 年 06 月 20 日	64,740.00	2,000.00	14	3.4 0	85.60	-	-
东方证券	20220620000014 74	光威复材	202 2 年 06 月 20 日	111,260.0 0	2,000.00	14	3.4 0	147.1 1	-	-
东方证券	20220627000011 98	中际旭创	202 2 年 06 月 27 日	62,000.00	2,000.00	14	3.4 0	81.98	-	-
东方证券	20220627000012 08	华测检测	202 2 年 06 月 27 日	46,640.00	2,000.00	14	3.4 0	61.67	-	-
东方证券	20220627000012 10	光威复材	202 2 年 06 月 27 日	91,360.00	1,600.00	14	3.4 0	120.8 0	-	-
东方证券	20220627000142 30	万达信息	202 2 年 06	18,300.00	2,000.00	14	3.4 0	24.20	-	-

			月 27 日							
东方 证 券	20220627000142 32	万 孚 生 物	202 2 年 06 月 27 日	81,600.00	2,000.00	14	3.4 0	107.8 9	-	-
东方 证 券	20220627000142 34	中 际 旭 创	202 2 年 06 月 27 日	62,000.00	2,000.00	14	3.4 0	81.98	-	-
东方 证 券	20220627000142 36	开 山 股 份	202 2 年 06 月 27 日	29,580.00	2,000.00	14	3.4 0	39.11	-	-
东方 证 券	20220627000143 52	三 聚 环 保	202 2 年 06 月 27 日	10,160.00	2,000.00	14	3.4 0	13.43	-	-
东方 证 券	20220627000143 54	网 宿 科 技	202 2 年 06 月 27 日	10,640.00	2,000.00	14	3.4 0	14.07	-	-
东方 证 券	20220627000143 60	华 测 检 测	202 2 年 06 月 27	46,640.00	2,000.00	14	3.4 0	61.67	-	-

			日							
东方证券	2022062700014364	稳健医疗	2022年06月27日	64,960.00	1,000.00	14	3.40	85.89	-	-
东方证券	2022062700014368	光威复材	2022年06月27日	114,200.00	2,000.00	14	3.40	151.00	-	-
东方证券	2022062700014376	易华录	2022年06月27日	34,560.00	2,000.00	14	3.40	45.70	-	-
东方证券	2022070400000879	中际旭创	2022年07月04日	30,620.00	1,000.00	14	3.40	40.49	-	-
东方证券	2022070400000897	昆仑万维	2022年07月04日	15,740.00	1,000.00	14	3.40	20.81	-	-
东方证券	2022070400000899	景嘉微	2022年07月04日	66,310.00	1,000.00	14	3.40	87.68	-	-
东	20220704000009	光	202	9,080.00	1,000.00	14	3.4	12.01	-	-

方证券	01	线传媒	2 年 07 月 04 日				0			
东方证券	20220704000009 03	我武生物	202 2 年 07 月 04 日	52,720.00	1,000.00	14	3.4 0	69.71	-	-
东方证券	20220704000009 07	信维通信	202 2 年 07 月 04 日	17,250.00	1,000.00	14	3.4 0	22.81	-	-
东方证券	20220704000009 08	宋城演艺	202 2 年 07 月 04 日	14,320.00	1,000.00	14	3.4 0	18.93	-	-
东方证券	20220704000009 11	国瓷材料	202 2 年 07 月 04 日	34,950.00	1,000.00	14	3.4 0	46.21	-	-
东方证券	20220704000009 13	卫宁健康	202 2 年 07 月 04 日	9,010.00	1,000.00	14	3.4 0	11.91	-	-
东方证	20220704000009 15	三聚环	202 2 年	5,240.00	1,000.00	14	3.4 0	6.93	-	-

券		保	07 月 04 日							
东方证 券	20220704000009 17	华 测 检 测	202 2 年 07 月 04 日	22,800.00	1,000.00	14	3.4 0	30.15	-	-
东方证 券	20220704000009 19	利 亚 德	202 2 年 07 月 04 日	6,830.00	1,000.00	14	3.4 0	9.03	-	-
招商证 券	20220704000009 21	机 器 人	202 2 年 07 月 04 日	20,240.00	2,000.00	14	3.6 0	28.34	-	-
东方证 券	20220704000141 36	易 华 录	202 2 年 07 月 04 日	33,402.00	1,900.00	14	3.4 0	44.16	-	-
东方证 券	20220704000141 42	网 宿 科 技	202 2 年 07 月 04 日	10,520.00	2,000.00	14	3.4 0	13.91	-	-
东方证 券	20220704000141 48	华 测 检 测	202 2 年 07 月	45,600.00	2,000.00	14	3.4 0	60.29	-	-

			04 日							
东方证 券	20220704000164 94	稳 健 医 疗	202 2 年 07 月 04 日	90,116.00	1,300.00	14	3.4 0	119.1 5	-	-
东方证 券	20220704000164 98	中 际 旭 创	202 2 年 07 月 04 日	61,240.00	2,000.00	14	3.4 0	80.97	-	-
东方证 券	20220704000165 06	光 威 复 材	202 2 年 07 月 04 日	121,660.0 0	2,000.00	14	3.4 0	160.8 6	-	-
东方证 券	20220704000165 14	机 器 人	202 2 年 07 月 04 日	20,240.00	2,000.00	14	3.4 0	26.76	-	-
东方证 券	20220711000169 18	万 达 信 息	202 2 年 07 月 11 日	18,000.00	2,000.00	14	3.4 0	23.80	-	-
东方证 券	20220711000169 30	万 孚 生 物	202 2 年 07 月 11 日	84,680.00	2,000.00	14	3.4 0	111.9 7	-	-

东方证券	2022071100016932	稳健医疗	2022年07月11日	73,200.00	1,000.00	14	3.40	96.79	-	-
东方证券	2022071100016934	光威复材	2022年07月11日	118,600.00	2,000.00	14	3.40	156.82	-	-
东方证券	2022071100016938	中际旭创	2022年07月11日	60,160.00	2,000.00	14	3.40	79.54	-	-
东方证券	2022071100016940	光威复材	2022年07月11日	94,880.00	1,600.00	14	3.40	125.45	-	-
东方证券	2022071100016946	开山股份	2022年07月11日	30,340.00	2,000.00	14	3.40	40.12	-	-
东方证券	2022071100017960	海新能科	2022年07月11日	10,340.00	2,000.00	14	3.40	13.67	-	-
东方	2022071100017962	易华	2022	33,800.00	2,000.00	14	3.40	44.69	-	-

证券		录	年 07 月 11 日							
东方证券	20220711000179 64	中际旭创	2022 年 07 月 11 日	60,160.00	2,000.00	14	3.4 0	79.54	-	-
东方证券	20220711000179 66	网宿科技	2022 年 07 月 11 日	10,260.00	2,000.00	14	3.4 0	13.57	-	-
东方证券	20220711000179 72	华测检测	2022 年 07 月 11 日	43,900.00	2,000.00	14	3.4 0	58.05	-	-
东方证券	20220711000179 76	华测检测	2022 年 07 月 11 日	43,900.00	2,000.00	14	3.4 0	58.05	-	-
招商证券	20220718000139 31	机器人	2022 年 07 月 18 日	19,500.00	2,000.00	14	3.6 0	27.30	-	-
东方证券	20220718000171 05	光线传媒	2022 年 07 月 07 日	8,300.00	1,000.00	14	3.4 0	10.97	-	-

			月 18 日							
东方 证 券	20220718000171 09	信 维 通 信	202 2 年 07 月 18 日	16,470.00	1,000.00	14	3.4 0	21.78	-	-
东方 证 券	20220718000171 11	国 瓷 材 料	202 2 年 07 月 18 日	33,000.00	1,000.00	14	3.4 0	43.63	-	-
东方 证 券	20220718000171 13	卫 宁 健 康	202 2 年 07 月 18 日	7,950.00	1,000.00	14	3.4 0	10.51	-	-
东方 证 券	20220718000171 23	海 新 能 科	202 2 年 07 月 18 日	5,080.00	1,000.00	14	3.4 0	6.72	-	-
东方 证 券	20220718000171 27	宋 城 演 艺	202 2 年 07 月 18 日	13,040.00	1,000.00	14	3.4 0	17.24	-	-
东方 证 券	20220718000171 33	华 测 检 测	202 2 年 07 月 18	42,000.00	2,000.00	14	3.4 0	55.53	-	-

			日							
东方证券	2022071800017135	华测检测	2022年07月18日	21,000.00	1,000.00	14	3.40	27.77	-	-
东方证券	2022071800017139	我武生物	2022年07月18日	51,800.00	1,000.00	14	3.40	68.49	-	-
东方证券	2022071800017147	利亚德	2022年07月18日	6,500.00	1,000.00	14	3.40	8.59	-	-
东方证券	2022071800017155	中际旭创	2022年07月18日	32,100.00	1,000.00	14	3.40	42.44	-	-
东方证券	2022071800017157	中际旭创	2022年07月18日	64,200.00	2,000.00	14	3.40	84.89	-	-
东方证券	2022071800017183	易华录	2022年07月18日	32,851.00	1,900.00	14	3.40	43.44	-	-
东	20220718000172	稳	202	93,912.00	1,300.00	14	3.4	124.1	-	-

方 证 券	07	健 医 疗	2 年 07 月 18 日				0	7		
东 方 证 券	20220718000172 13	光 威 复 材	202 2 年 07 月 18 日	137,760.0 0	2,000.00	14	3.4 0	182.1 5	-	-
东 方 证 券	20220718000172 23	昆 仑 万 维	202 2 年 07 月 18 日	14,670.00	1,000.00	14	3.4 0	19.40	-	-
东 方 证 券	20220718000172 25	网 宿 科 技	202 2 年 07 月 18 日	10,440.00	2,000.00	14	3.4 0	13.80	-	-
东 方 证 券	20220718000172 33	景 嘉 微	202 2 年 07 月 18 日	62,830.00	1,000.00	14	3.4 0	83.08	-	-
东 方 证 券	20220718000172 47	机 器 人	202 2 年 07 月 18 日	19,500.00	2,000.00	14	3.4 0	25.78	-	-
东 方 证 券	20220725000009 90	长 盈 精	202 2 年	10,620.00	1,000.00	14	3.4 0	14.04	-	-

券		密	07 月 25 日							
东方证 券	20220725000009 91	信 维 通 信	202 2 年 07 月 25 日	16,950.00	1,000.00	14	3.4 0	22.41	-	-
东方证 券	20220725000009 93	光 环 新 网	202 2 年 07 月 25 日	9,370.00	1,000.00	14	3.4 0	12.39	-	-
东方证 券	20220725000009 94	利 亚 德	202 2 年 07 月 25 日	6,340.00	1,000.00	14	3.4 0	8.38	-	-
东方证 券	20220725000010 01	特 锐 德	202 2 年 07 月 25 日	18,400.00	1,000.00	14	3.4 0	24.33	-	-
东方证 券	20220725000010 02	光 线 传 媒	202 2 年 07 月 25 日	8,360.00	1,000.00	14	3.4 0	11.05	-	-
东方证 券	20220725000010 03	蓝 色 光 标	202 2 年 07 月	5,810.00	1,000.00	14	3.4 0	7.68	-	-

			25 日							
东方证 券	20220725000010 04	网 宿 科 技	202 2 年 07 月 25 日	5,200.00	1,000.00	14	3.4 0	6.88	-	-
东方证 券	20220725000010 06	海 新 能 科	202 2 年 07 月 25 日	5,020.00	1,000.00	14	3.4 0	6.64	-	-
东方证 券	20220725000010 23	华 测 检 测	202 2 年 07 月 25 日	21,310.00	1,000.00	14	3.4 0	28.18	-	-
东方证 券	20220725000151 42	万 达 信 息	202 2 年 07 月 25 日	18,520.00	2,000.00	14	3.4 0	24.49	-	-
东方证 券	20220725000151 54	中 际 旭 创	202 2 年 07 月 25 日	68,560.00	2,000.00	14	3.4 0	90.65	-	-
东方证 券	20220725000151 58	开 山 股 份	202 2 年 07 月 25 日	29,800.00	2,000.00	14	3.4 0	39.40	-	-

东方证券	2022072500015162	光威复材	2022年07月25日	112,448.00	1,600.00	14	3.40	148.68	-	-
东方证券	2022072500015168	华测检测	2022年07月25日	42,620.00	2,000.00	14	3.40	56.35	-	-
东方证券	2022072500015178	万孚生物	2022年07月25日	80,340.00	2,000.00	14	3.40	106.23	-	-
东方证券	2022072500015194	稳健医疗	2022年07月25日	71,070.00	1,000.00	14	3.40	93.97	-	-
东方证券	2022072500015196	华测检测	2022年07月25日	42,620.00	2,000.00	14	3.40	56.35	-	-
东方证券	2022072500015200	光威复材	2022年07月25日	140,560.00	2,000.00	14	3.40	185.85	-	-
东方	2022072500015206	海新	2022	10,040.00	2,000.00	14	3.40	13.28	-	-

证券		能科	年 07 月 25 日							
东方证券	20220725000152 08	易华录	202 2 年 07 月 25 日	33,780.00	2,000.00	14	3.4 0	44.66	-	-
东方证券	20220725000152 10	中际旭创	202 2 年 07 月 25 日	68,560.00	2,000.00	14	3.4 0	90.65	-	-
东方证券	20220725000152 12	网宿科技	202 2 年 07 月 25 日	10,400.00	2,000.00	14	3.4 0	13.75	-	-
东方证券	20220801000006 96	万达信息	202 2 年 08 月 01 日	9,400.00	1,000.00	14	3.4 0	12.43	-	-
东方证券	20220801000006 97	蓝色光标	202 2 年 08 月 01 日	5,950.00	1,000.00	14	3.4 0	7.87	-	-
东方证券	20220801000006 98	光线传媒	202 2 年 08 月 08 日	8,510.00	1,000.00	14	3.4 0	11.25	-	-

			月 01 日							
东方 证 券	20220801000006 99	我 武 生 物	202 2 年 08 月 01 日	94,540.00	2,000.00	14	3.4 0	125.0 0	-	-
东方 证 券	20220801000007 05	长 盈 精 密	202 2 年 08 月 01 日	12,290.00	1,000.00	14	3.4 0	16.25	-	-
东方 证 券	20220801000007 06	海 新 能 科	202 2 年 08 月 01 日	5,060.00	1,000.00	14	3.4 0	6.69	-	-
东方 证 券	20220801000007 08	网 宿 科 技	202 2 年 08 月 01 日	5,300.00	1,000.00	14	3.4 0	7.01	-	-
东方 证 券	20220801000007 13	信 维 通 信	202 2 年 08 月 01 日	17,590.00	1,000.00	14	3.4 0	23.26	-	-
东方 证 券	20220801000124 85	我 武 生 物	202 2 年 08 月 01	47,270.00	1,000.00	14	3.4 0	62.50	-	-

			日							
东方证券	2022080100012497	利亚德	2022年08月01日	6,640.00	1,000.00	14	3.40	8.78	-	-
东方证券	2022080100012499	中际旭创	2022年08月01日	65,960.00	2,000.00	14	3.40	87.21	-	-
东方证券	2022080100012501	中际旭创	2022年08月01日	32,980.00	1,000.00	14	3.40	43.61	-	-
东方证券	2022080100012541	光威复材	2022年08月01日	144,700.00	2,000.00	14	3.40	191.33	-	-
东方证券	2022080100012545	卫宁健康	2022年08月01日	7,930.00	1,000.00	14	3.40	10.49	-	-
东方证券	2022080100012567	国瓷材料	2022年08月01日	33,080.00	1,000.00	14	3.40	43.74	-	-
东	20220801000125	易	202	33,516.00	1,900.00	14	3.4	44.32	-	-

方 证 券	69	华 录	2 年 08 月 01 日				0			
东 方 证 券	20220801000125 77	光 线 传 媒	202 2 年 08 月 01 日	8,510.00	1,000.00	14	3.4 0	11.25	-	-
东 方 证 券	20220801000125 95	信 维 通 信	202 2 年 08 月 01 日	17,590.00	1,000.00	14	3.4 0	23.26	-	-
东 方 证 券	20220801000126 05	华 测 检 测	202 2 年 08 月 01 日	40,900.00	2,000.00	14	3.4 0	54.08	-	-
东 方 证 券	20220801000126 07	华 测 检 测	202 2 年 08 月 01 日	20,450.00	1,000.00	14	3.4 0	27.04	-	-
东 方 证 券	20220801000126 13	昆 仑 万 维	202 2 年 08 月 01 日	14,400.00	1,000.00	14	3.4 0	19.04	-	-
东 方 证 券	20220801000126 19	景 嘉 微	202 2 年	60,080.00	1,000.00	14	3.4 0	79.44	-	-

券			08 月 01 日							
东方证 券	20220801000126 35	稳健医 疗	202 2年 08月 01日	93,288.00	1,300.00	14	3.4 0	123.3 5	-	-
东方证 券	20220801000126 43	机器 人	202 2年 08月 01日	22,800.00	2,000.00	14	3.4 0	30.15	-	-
东方证 券	20220801000126 47	海新 能科	202 2年 08月 01日	5,060.00	1,000.00	14	3.4 0	6.69	-	-
东方证 券	20220801000147 21	宋城 演 艺	202 2年 08月 01日	12,930.00	1,000.00	14	3.4 0	17.10	-	-
东方证 券	20220801000147 25	网 宿 科 技	202 2年 08月 01日	10,600.00	2,000.00	14	3.4 0	14.02	-	-
东方证 券	20220808000010 79	蓝 色 光 标	202 2年 08月	5,860.00	1,000.00	14	3.4 0	7.75	-	-

			08 日							
东方证 券	20220808000010 81	光线 传媒	202 2年 08月 08日	8,600.00	1,000.00	14	3.4 0	11.37	-	-
东方证 券	20220808000010 87	易华 录	202 2年 08月 08日	17,750.00	1,000.00	14	3.4 0	23.47	-	-
东方证 券	20220808000010 88	万达 信息	202 2年 08月 08日	9,680.00	1,000.00	14	3.4 0	12.80	-	-
东方证 券	20220808000010 90	网宿 科技	202 2年 08月 08日	5,420.00	1,000.00	14	3.4 0	7.17	-	-
东方证 券	20220808000010 91	东方 国信	202 2年 08月 08日	9,220.00	1,000.00	14	3.4 0	12.19	-	-
东方证 券	20220808000010 92	海新 能科	202 2年 08月 08日	4,950.00	1,000.00	14	3.4 0	6.55	-	-

东方证券	2022080800001093	长盈精密	2022年08月08日	12,180.00	1,000.00	14	3.40	16.10	-	-
东方证券	2022080800001103	信维通信	2022年08月08日	18,060.00	1,000.00	14	3.40	23.88	-	-
东方证券	2022080800019651	海新能科	2022年08月08日	4,950.00	1,000.00	14	3.40	6.55	-	-
东方证券	2022080800019661	长盈精密	2022年08月08日	12,180.00	1,000.00	14	3.40	16.10	-	-
东方证券	2022080800019663	信维通信	2022年08月08日	18,060.00	1,000.00	14	3.40	23.88	-	-
东方证券	2022080800019665	特锐德	2022年08月08日	18,200.00	1,000.00	14	3.40	24.06	-	-
东方	2022080800019681	网宿	2022	5,420.00	1,000.00	14	3.40	7.17	-	-

证券		科技	年 08 月 08 日							
东方证券	20220808000196 91	利亚德	202 2 年 08 月 08 日	6,680.00	1,000.00	14	3.4 0	8.83	-	-
东方证券	20220808000196 93	光线传媒	202 2 年 08 月 08 日	8,600.00	1,000.00	14	3.4 0	11.37	-	-
东方证券	20220808000197 01	光环新网	202 2 年 08 月 08 日	9,840.00	1,000.00	14	3.4 0	13.01	-	-
东方证券	20220808000197 11	华测检测	202 2 年 08 月 08 日	20,600.00	1,000.00	14	3.4 0	27.24	-	-
东方证券	20220808000197 15	蓝色光标	202 2 年 08 月 08 日	5,860.00	1,000.00	14	3.4 0	7.75	-	-
东方证券	20220808000197 19	万达信息	202 2 年 08 月 08 日	19,360.00	2,000.00	14	3.4 0	25.60	-	-

			月 08 日							
东方 证 券	20220808000197 21	易 华 录	202 2 年 08 月 08 日	35,500.00	2,000.00	14	3.4 0	46.94	-	-
东方 证 券	20220808000197 35	光 威 复 材	202 2 年 08 月 08 日	115,744.0 0	1,600.00	14	3.4 0	153.0 4	-	-
东方 证 券	20220808000197 47	中 际 旭 创	202 2 年 08 月 08 日	66,400.00	2,000.00	14	3.4 0	87.80	-	-
东方 证 券	20220808000197 51	海 新 能 科	202 2 年 08 月 08 日	9,900.00	2,000.00	14	3.4 0	13.09	-	-
东方 证 券	20220808000197 63	华 测 检 测	202 2 年 08 月 08 日	41,200.00	2,000.00	14	3.4 0	54.48	-	-
东方 证 券	20220808000197 67	华 测 检 测	202 2 年 08 月 08 日	41,200.00	2,000.00	14	3.4 0	54.48	-	-

			日							
东方证券	2022080800019781	稳健医疗	2022年08月08日	73,080.00	1,000.00	14	3.40	96.63	-	-
东方证券	2022080800022131	网宿科技	2022年08月08日	10,840.00	2,000.00	14	3.40	14.33	-	-
东方证券	2022080800023073	万孚生物	2022年08月08日	72,780.00	2,000.00	14	3.40	96.23	-	-
东方证券	2022080800023079	光威复材	2022年08月08日	144,680.00	2,000.00	14	3.40	191.30	-	-
东方证券	2022080800023089	开山股份	2022年08月08日	30,060.00	2,000.00	14	3.40	39.75	-	-
东方证券	2022080800023091	中际旭创	2022年08月08日	66,400.00	2,000.00	14	3.40	87.80	-	-
东	20220815000012	光	202	19,780.00	2,000.00	14	3.4	26.15	-	-

方证券	89	环新网	2 年 08 月 15 日				0			
东方证券	20220815000012 91	蓝色光标	202 2 年 08 月 15 日	12,200.00	2,000.00	14	3.4 0	16.13	-	-
东方证券	20220815000012 98	网宿科技	202 2 年 08 月 15 日	10,720.00	2,000.00	14	3.4 0	14.17	-	-
东方证券	20220815000013 03	华测检测	202 2 年 08 月 15 日	41,460.00	2,000.00	14	3.4 0	54.82	-	-
东方证券	20220815000013 04	中际旭创	202 2 年 08 月 15 日	50,550.00	1,500.00	14	3.4 0	66.84	-	-
东方证券	20220815000013 05	东方国信	202 2 年 08 月 15 日	18,160.00	2,000.00	14	3.4 0	24.01	-	-
东方证	20220815000013 06	海新能	202 2 年	9,840.00	2,000.00	14	3.4 0	13.01	-	-

券		科	08 月 15 日							
东方证 券	20220815000163 05	网 宿 科 技	202 2 年 08 月 15 日	5,360.00	1,000.00	14	3.4 0	7.09	-	-
东方证 券	20220815000163 11	信 维 通 信	202 2 年 08 月 15 日	18,080.00	1,000.00	14	3.4 0	23.91	-	-
东方证 券	20220815000163 79	利 亚 德	202 2 年 08 月 15 日	6,800.00	1,000.00	14	3.4 0	8.99	-	-
东方证 券	20220815000164 45	光 线 传 媒	202 2 年 08 月 15 日	9,010.00	1,000.00	14	3.4 0	11.91	-	-
东方证 券	20220815000164 47	海 新 能 科	202 2 年 08 月 15 日	4,920.00	1,000.00	14	3.4 0	6.51	-	-
东方证 券	20220815000175 53	稳 健 医 疗	202 2 年 08 月	93,080.00	1,300.00	14	3.4 0	123.0 7	-	-

			15 日							
东方证 券	20220815000176 03	景嘉 微	202 2年 08月 15日	62,580.00	1,000.00	14	3.4 0	82.74	-	-
东方证 券	20220815000181 41	国瓷 材料	202 2年 08月 15日	35,000.00	1,000.00	14	3.4 0	46.28	-	-
东方证 券	20220815000181 87	蓝色 光标	202 2年 08月 15日	6,100.00	1,000.00	14	3.4 0	8.07	-	-
东方证 券	20220815000181 97	万达 信息	202 2年 08月 15日	9,570.00	1,000.00	14	3.4 0	12.65	-	-
东方证 券	20220815000181 99	我武 生物	202 2年 08月 15日	93,280.00	2,000.00	14	3.4 0	123.3 4	-	-
东方证 券	20220815000182 35	华测 检测	202 2年 08月 15日	41,460.00	2,000.00	14	3.4 0	54.82	-	-

东方证券	2022081500018237	华测检测	2022年08月15日	20,730.00	1,000.00	14	3.40	27.41	-	-
东方证券	2022081500018243	网宿科技	2022年08月15日	10,720.00	2,000.00	14	3.40	14.17	-	-
东方证券	2022081500018261	机器人	2022年08月15日	25,020.00	2,000.00	14	3.40	33.08	-	-
东方证券	2022081500018275	宋城演艺	2022年08月15日	12,650.00	1,000.00	14	3.40	16.73	-	-
东方证券	2022081500018353	信维通信	2022年08月15日	18,080.00	1,000.00	14	3.40	23.91	-	-
东方证券	2022081500018367	长盈精密	2022年08月15日	13,750.00	1,000.00	14	3.40	18.18	-	-
东方	2022081500019343	中际	2022	67,400.00	2,000.00	14	3.40	89.12	-	-

证券		旭创	年 08 月 15 日							
东方证券	20220815000193 45	中际旭创	202 2 年 08 月 15 日	33,700.00	1,000.00	14	3.4 0	44.56	-	-
东方证券	20220815000193 89	光威复材	202 2 年 08 月 15 日	149,900.0 0	2,000.00	14	3.4 0	198.2 0	-	-
东方证券	20220815000194 41	易华录	202 2 年 08 月 15 日	33,953.00	1,900.00	14	3.4 0	44.89	-	-
东方证券	20220815000194 47	光线传媒	202 2 年 08 月 15 日	9,010.00	1,000.00	14	3.4 0	11.91	-	-
东方证券	20220815000194 49	卫宁健康	202 2 年 08 月 15 日	8,070.00	1,000.00	14	3.4 0	10.67	-	-
东方证券	20220815000194 61	我武生物	202 2 年 08 月 08 日	46,640.00	1,000.00	14	3.4 0	61.67	-	-

			月 15 日							
东方 证 券	20220815000194 73	昆 仑 万 维	202 2 年 08 月 15 日	14,890.00	1,000.00	14	3.4 0	19.69	-	-
东方 证 券	20220815000194 79	海 新 能 科	202 2 年 08 月 15 日	4,920.00	1,000.00	14	3.4 0	6.51	-	-
东方 证 券	20220822000182 57	利 亚 德	202 2 年 08 月 22 日	7,010.00	1,000.00	14	3.4 0	9.27	-	-
东方 证 券	20220822000182 59	中 际 旭 创	202 2 年 08 月 22 日	66,160.00	2,000.00	14	3.4 0	87.48	-	-
东方 证 券	20220822000182 61	中 际 旭 创	202 2 年 08 月 22 日	66,160.00	2,000.00	14	3.4 0	87.48	-	-
东方 证 券	20220822000182 65	特 锐 德	202 2 年 08 月 22	19,090.00	1,000.00	14	3.4 0	25.24	-	-

			日							
东方证券	2022082200018275	万达信息	2022年08月22日	19,120.00	2,000.00	14	3.40	25.28	-	-
东方证券	2022082200018281	蓝色光标	2022年08月22日	6,160.00	1,000.00	14	3.40	8.14	-	-
东方证券	2022082200018285	海新能科	2022年08月22日	4,990.00	1,000.00	14	3.40	6.60	-	-
东方证券	2022082200018289	华测检测	2022年08月22日	41,560.00	2,000.00	14	3.40	54.95	-	-
东方证券	2022082200018293	光环新网	2022年08月22日	9,940.00	1,000.00	14	3.40	13.14	-	-
东方证券	2022082200018295	光线传媒	2022年08月22日	9,660.00	1,000.00	14	3.40	12.77	-	-
东	20220822000182	易	202	33,040.00	2,000.00	14	3.4	43.69	-	-

方 证 券	97	华 录	2 年 08 月 22 日				0			
东 方 证 券	20220822000183 69	光 威 复 材	202 2 年 08 月 22 日	120,240.0 0	1,600.00	14	3.4 0	158.9 8	-	-
东 方 证 券	20220822000183 93	开 山 股 份	202 2 年 08 月 22 日	31,920.00	2,000.00	14	3.4 0	42.21	-	-
东 方 证 券	20220822000183 97	网 宿 科 技	202 2 年 08 月 22 日	10,600.00	2,000.00	14	3.4 0	14.02	-	-
东 方 证 券	20220822000183 99	网 宿 科 技	202 2 年 08 月 22 日	5,300.00	1,000.00	14	3.4 0	7.01	-	-
东 方 证 券	20220822000184 01	稳 健 医 疗	202 2 年 08 月 22 日	75,000.00	1,000.00	14	3.4 0	99.17	-	-
东 方 证 券	20220822000184 37	长 盈 精	202 2 年	15,210.00	1,000.00	14	3.4 0	20.11	-	-

券		密	08 月 22 日							
东方证 券	20220822000184 43	信 维 通 信	202 2 年 08 月 22 日	17,940.00	1,000.00	14	3.4 0	23.72	-	-
东方证 券	20220822000216 07	海 新 能 科	202 2 年 08 月 22 日	9,980.00	2,000.00	14	3.4 0	13.20	-	-
东方证 券	20220822000216 09	华 测 检 测	202 2 年 08 月 22 日	20,780.00	1,000.00	14	3.4 0	27.48	-	-
东方证 券	20220822000216 11	华 测 检 测	202 2 年 08 月 22 日	41,560.00	2,000.00	14	3.4 0	54.95	-	-
东方证 券	20220822000216 21	万 孚 生 物	202 2 年 08 月 22 日	71,400.00	2,000.00	14	3.4 0	94.41	-	-
东方证 券	20220822000216 23	光 威 复 材	202 2 年 08 月	150,300.0 0	2,000.00	14	3.4 0	198.7 3	-	-

			22 日							
东方证 券	20220829000154 37	东方国 信	202 2年 08月 29日	16,980.00	2,000.00	14	3.4 0	24.06	-	-
东方证 券	20220829000154 39	华测检 测	202 2年 08月 29日	43,160.00	2,000.00	14	3.4 0	61.14	-	-
东方证 券	20220829000154 45	网宿科 技	202 2年 08月 29日	10,140.00	2,000.00	14	3.4 0	14.37	-	-
东方证 券	20220829000154 49	蓝色光 标	202 2年 08月 29日	11,620.00	2,000.00	14	3.4 0	16.46	-	-
东方证 券	20220829000154 51	中际旭 创	202 2年 08月 29日	44,820.00	1,500.00	14	3.4 0	63.50	-	-
东方证 券	20220829000154 55	海新能 科	202 2年 08月 29日	9,700.00	2,000.00	14	3.4 0	13.74	-	-

东方证券	2022082900015513	信维通信	2022年08月29日	16,850.00	1,000.00	14	3.40	23.87	-	-
东方证券	2022082900015525	利亚德	2022年08月29日	6,470.00	1,000.00	14	3.40	9.17	-	-
东方证券	2022082900015529	网宿科技	2022年08月29日	5,070.00	1,000.00	14	3.40	7.18	-	-
东方证券	2022082900015751	稳健医疗	2022年08月29日	92,430.00	1,300.00	14	3.40	130.94	-	-
东方证券	2022082900015771	宋城演艺	2022年08月29日	12,790.00	1,000.00	14	3.40	18.12	-	-
东方证券	2022082900015787	网宿科技	2022年08月29日	10,140.00	2,000.00	14	3.40	14.37	-	-
东方	2022082900015791	我武	2022	90,400.00	2,000.00	14	3.40	128.07	-	-

证券		生物	年 08 月 29 日							
东方证 券	20220829000173 13	光 环 新 网	202 2 年 08 月 29 日	18,620.00	2,000.00	14	3.4 0	26.38	-	-
东方证 券	20220829000174 13	光 线 传 媒	202 2 年 08 月 29 日	9,340.00	1,000.00	14	3.4 0	13.23	-	-
东方证 券	20220829000174 69	国 瓷 材 料	202 2 年 08 月 29 日	32,360.00	1,000.00	14	3.4 0	45.84	-	-
东方证 券	20220829000174 83	蓝 色 光 标	202 2 年 08 月 29 日	5,810.00	1,000.00	14	3.4 0	8.23	-	-
东方证 券	20220829000174 85	海 新 能 科	202 2 年 08 月 29 日	4,850.00	1,000.00	14	3.4 0	6.87	-	-
东方证 券	20220829000185 77	华 测 检 测	202 2 年 08	43,160.00	2,000.00	14	3.4 0	61.14	-	-

			月 29 日							
东方 证 券	20220829000185 79	华 测 检 测	202 2 年 08 月 29 日	21,580.00	1,000.00	14	3.4 0	30.57	-	-
东方 证 券	20220829000186 01	万 达 信 息	202 2 年 08 月 29 日	8,880.00	1,000.00	14	3.4 0	12.58	-	-
东方 证 券	20220829000186 03	易 华 录	202 2 年 08 月 29 日	28,386.00	1,900.00	14	3.4 0	40.21	-	-
东方 证 券	20220829000186 09	光 线 传 媒	202 2 年 08 月 29 日	9,340.00	1,000.00	14	3.4 0	13.23	-	-
东方 证 券	20220829000186 11	卫 宁 健 康	202 2 年 08 月 29 日	7,150.00	1,000.00	14	3.4 0	10.13	-	-
东方 证 券	20220829000186 39	光 威 复 材	202 2 年 08 月 29	156,800.0 0	2,000.00	14	3.4 0	222.1 3	-	-

			日							
东方证券	2022082900018861	景嘉微	2022年08月29日	55,700.00	1,000.00	14	3.40	78.91	-	-
东方证券	2022082900018879	长盈精密	2022年08月29日	14,440.00	1,000.00	14	3.40	20.46	-	-
东方证券	2022082900018889	信维通信	2022年08月29日	16,850.00	1,000.00	14	3.40	23.87	-	-
东方证券	2022082900018897	中际旭创	2022年08月29日	59,760.00	2,000.00	14	3.40	84.66	-	-
东方证券	2022082900018899	中际旭创	2022年08月29日	29,880.00	1,000.00	14	3.40	42.33	-	-
东方证券	2022082900018919	我武生物	2022年08月29日	45,200.00	1,000.00	14	3.40	64.03	-	-
东	20220829000189	昆	202	14,510.00	1,000.00	14	3.4	20.56	-	-

方证券	35	仑万维	2 年 08 月 29 日				0			
东方证券	20220829000189 41	机器人	202 2 年 08 月 29 日	20,400.00	2,000.00	14	3.4 0	28.90	-	-
东方证券	20220829000189 49	海新能科	202 2 年 08 月 29 日	4,850.00	1,000.00	14	3.4 0	6.87	-	-
东方证券	20220905000210 33	光威复材	202 2 年 09 月 05 日	127,680.0 0	1,600.00	14	3.4 0	168.8 2	-	-
东方证券	20220905000210 35	光威复材	202 2 年 09 月 05 日	159,600.0 0	2,000.00	14	3.4 0	211.0 3	-	-
东方证券	20220905000210 61	特锐德	202 2 年 09 月 05 日	16,900.00	1,000.00	14	3.4 0	22.35	-	-
东方证	20220905000210 67	华测检	202 2 年	43,060.00	2,000.00	14	3.4 0	56.93	-	-

券		测	09 月 05 日							
东方证 券	20220905000210 71	华 测 检 测	202 2 年 09 月 05 日	21,530.00	1,000.00	14	3.4 0	28.47	-	-
东方证 券	20220905000210 73	华 测 检 测	202 2 年 09 月 05 日	43,060.00	2,000.00	14	3.4 0	56.93	-	-
东方证 券	20220905000210 77	网 宿 科 技	202 2 年 09 月 05 日	10,180.00	2,000.00	14	3.4 0	13.46	-	-
东方证 券	20220905000210 79	网 宿 科 技	202 2 年 09 月 05 日	5,090.00	1,000.00	14	3.4 0	6.73	-	-
东方证 券	20220905000210 85	光 环 新 网	202 2 年 09 月 05 日	9,340.00	1,000.00	14	3.4 0	12.35	-	-
东方证 券	20220905000211 03	万 孚 生 物	202 2 年 09 月	64,520.00	2,000.00	14	3.4 0	85.31	-	-

			05 日							
东方证 券	20220905000211 15	蓝色 光标	202 2年 09月 05日	5,560.00	1,000.00	14	3.4 0	7.35	-	-
东方证 券	20220905000211 17	海新 能科	202 2年 09月 05日	4,720.00	1,000.00	14	3.4 0	6.24	-	-
东方证 券	20220905000211 19	海新 能科	202 2年 09月 05日	9,440.00	2,000.00	14	3.4 0	12.48	-	-
东方证 券	20220905000211 25	长盈 精密	202 2年 09月 05日	13,370.00	1,000.00	14	3.4 0	17.68	-	-
东方证 券	20220905000211 31	信维 通信	202 2年 09月 05日	17,150.00	1,000.00	14	3.4 0	22.68	-	-
东方证 券	20220905000211 63	中际 旭创	202 2年 09月 05日	58,500.00	2,000.00	14	3.4 0	77.35	-	-

东方证券	2022090500021165	中际旭创	2022年09月05日	58,500.00	2,000.00	14	3.40	77.35	-	-
东方证券	2022090500021169	万达信息	2022年09月05日	17,100.00	2,000.00	14	3.40	22.61	-	-
东方证券	2022090500021171	易华录	2022年09月05日	28,940.00	2,000.00	14	3.40	38.27	-	-
东方证券	2022090500021175	光线传媒	2022年09月05日	9,250.00	1,000.00	14	3.40	12.23	-	-
东方证券	2022090500021181	开山股份	2022年09月05日	38,080.00	2,000.00	14	3.40	50.35	-	-
东方证券	2022090500021185	利亚德	2022年09月05日	6,300.00	1,000.00	14	3.40	8.33	-	-
东方	2022090500024843	稳健	2022	73,600.00	1,000.00	14	3.40	97.32	-	-

证券		医疗	年 09 月 05 日							
东方证券	20220913000219 09	万达信息	202 2 年 09 月 13 日	8,400.00	1,000.00	14	3.4 0	11.11	-	-
东方证券	20220913000219 13	易华录	202 2 年 09 月 13 日	27,265.00	1,900.00	14	3.4 0	36.05	-	-
东方证券	20220913000219 17	光线传媒	202 2 年 09 月 13 日	9,090.00	1,000.00	14	3.4 0	12.02	-	-
东方证券	20220913000219 21	国瓷材料	202 2 年 09 月 13 日	32,220.00	1,000.00	14	3.4 0	42.60	-	-
东方证券	20220913000219 25	利亚德	202 2 年 09 月 13 日	6,270.00	1,000.00	14	3.4 0	8.29	-	-
东方证券	20220913000219 29	中际旭创	202 2 年 09 月 09 日	43,530.00	1,500.00	14	3.4 0	57.56	-	-

			月 13 日							
东方 证 券	20220913000241 29	东 方 国 信	202 2 年 09 月 13 日	16,520.00	2,000.00	14	3.4 0	21.84	-	-
东方 证 券	20220913000242 29	景 嘉 微	202 2 年 09 月 13 日	56,150.00	1,000.00	14	3.4 0	74.24	-	-
东方 证 券	20220913000242 55	华 测 检 测	202 2 年 09 月 13 日	43,480.00	2,000.00	14	3.4 0	57.49	-	-
东方 证 券	20220913000242 59	网 宿 科 技	202 2 年 09 月 13 日	10,140.00	2,000.00	14	3.4 0	13.41	-	-
东方 证 券	20220913000242 63	海 新 能 科	202 2 年 09 月 13 日	9,280.00	2,000.00	14	3.4 0	12.27	-	-
东方 证 券	20220913000243 21	我 武 生 物	202 2 年 09 月 13	95,320.00	2,000.00	14	3.4 0	126.0 3	-	-

			日							
东方证券	2022091300024331	稳健医疗	2022年09月13日	90,948.00	1,300.00	14	3.40	120.25	-	-
东方证券	2022091300026757	华测检测	2022年09月13日	43,480.00	2,000.00	14	3.40	57.49	-	-
东方证券	2022091300026761	华测检测	2022年09月13日	21,740.00	1,000.00	14	3.40	28.75	-	-
东方证券	2022091300026767	网宿科技	2022年09月13日	5,070.00	1,000.00	14	3.40	6.70	-	-
东方证券	2022091300026769	网宿科技	2022年09月13日	10,140.00	2,000.00	14	3.40	13.41	-	-
东方证券	2022091300026773	海新能科	2022年09月13日	4,640.00	1,000.00	14	3.40	6.14	-	-
东	20220913000267	长	202	13,530.00	1,000.00	14	3.4	17.89	-	-

方证券	77	盈精密	2 年 09 月 13 日				0			
东方证券	20220913000268 33	光威复材	202 2 年 09 月 13 日	171,620.0 0	2,000.00	14	3.4 0	226.9 2	-	-
东方证券	20220913000268 57	光环新网	202 2 年 09 月 13 日	18,460.00	2,000.00	14	3.4 0	24.41	-	-
东方证券	20220913000268 61	蓝色光标	202 2 年 09 月 13 日	5,390.00	1,000.00	14	3.4 0	7.13	-	-
东方证券	20220913000268 63	蓝色光标	202 2 年 09 月 13 日	10,780.00	2,000.00	14	3.4 0	14.25	-	-
东方证券	20220913000268 65	信维通信	202 2 年 09 月 13 日	16,550.00	1,000.00	14	3.4 0	21.88	-	-
东方证	20220913000268 67	宋城演	202 2 年	12,880.00	1,000.00	14	3.4 0	17.03	-	-

券		艺	09 月 13 日							
东方证 券	20220913000287 81	昆仑 万维	202 2年 09月 13日	14,000.00	1,000.00	14	3.4 0	18.51	-	-
东方证 券	20220913000288 05	光线 传媒	202 2年 09月 13日	9,090.00	1,000.00	14	3.4 0	12.02	-	-
东方证 券	20220913000288 07	卫宁 健康	202 2年 09月 13日	6,850.00	1,000.00	14	3.4 0	9.06	-	-
东方证 券	20220913000288 15	中际 旭创	202 2年 09月 13日	58,040.00	2,000.00	14	3.4 0	76.74	-	-
东方证 券	20220913000288 17	中际 旭创	202 2年 09月 13日	29,020.00	1,000.00	14	3.4 0	38.37	-	-
东方证 券	20220913000288 29	海新 能科	202 2年 09月	4,640.00	1,000.00	14	3.4 0	6.14	-	-

			13 日							
东方证 券	20220913000288 55	我 武 生 物	202 2 年 09 月 13 日	47,660.00	1,000.00	14	3.4 0	63.02	-	-
东方证 券	20220913000288 83	机 器 人	202 2 年 09 月 13 日	19,940.00	2,000.00	14	3.4 0	26.37	-	-
东方证 券	20220913000288 93	信 维 通 信	202 2 年 09 月 13 日	16,550.00	1,000.00	14	3.4 0	21.88	-	-
东方证 券	20220926000006 79	九 号 公 司 - W D	202 2 年 09 月 26 日	77,200.00	2,000.00	14	3.4 0	102.0 8	-	-
东方证 券	20220927000225 67	网 宿 科 技	202 2 年 09 月 27 日	4,720.00	1,000.00	14	3.4 0	6.24	-	-
东方证 券	20220927000225 69	网 宿 科 技	202 2 年 09 月 27 日	9,440.00	2,000.00	14	3.4 0	12.48	-	-

东方证券	2022092700022575	稳健医疗	2022年09月27日	86,190.00	1,300.00	14	3.40	113.96	-	-
东方证券	2022092700022581	机器人	2022年09月27日	18,540.00	2,000.00	14	3.40	24.51	-	-
东方证券	2022092700022593	我武生物	2022年09月27日	47,590.00	1,000.00	14	3.40	62.92	-	-
东方证券	2022092700022597	光线传媒	2022年09月27日	7,570.00	1,000.00	14	3.40	10.01	-	-
东方证券	2022092700022605	宋城演艺	2022年09月27日	13,060.00	1,000.00	14	3.40	17.27	-	-
东方证券	2022092700022611	卫宁健康	2022年09月27日	6,540.00	1,000.00	14	3.40	8.65	-	-
东方	2022092700022619	华测	2022	42,200.00	2,000.00	14	3.40	55.80	-	-

证券		检测	年 09 月 27 日							
东方证券	20220927000226 21	华 测 检 测	202 2 年 09 月 27 日	21,100.00	1,000.00	14	3.4 0	27.90	-	-
东方证券	20220927000226 29	海 新 能 科	202 2 年 09 月 27 日	8,680.00	2,000.00	14	3.4 0	11.48	-	-
东方证券	20220927000226 31	蓝 色 光 标	202 2 年 09 月 27 日	9,600.00	2,000.00	14	3.4 0	12.69	-	-
东方证券	20220927000226 33	海 新 能 科	202 2 年 09 月 27 日	4,340.00	1,000.00	14	3.4 0	5.74	-	-
东方证券	20220927000226 35	海 新 能 科	202 2 年 09 月 27 日	4,340.00	1,000.00	14	3.4 0	5.74	-	-
东方证券	20220927000226 37	长 盈 精 密	202 2 年 09	11,670.00	1,000.00	14	3.4 0	15.43	-	-

			月 27 日							
东方 证 券	20220927000226 47	信 维 通 信	202 2 年 09 月 27 日	14,900.00	1,000.00	14	3.4 0	19.70	-	-
东方 证 券	20220927000226 51	信 维 通 信	202 2 年 09 月 27 日	14,900.00	1,000.00	14	3.4 0	19.70	-	-
东方 证 券	20220927000226 65	东 方 国 信	202 2 年 09 月 27 日	15,100.00	2,000.00	14	3.4 0	19.97	-	-
东方 证 券	20220927000245 55	利 亚 德	202 2 年 09 月 27 日	5,700.00	1,000.00	14	3.4 0	7.54	-	-
东方 证 券	20220927000245 75	网 宿 科 技	202 2 年 09 月 27 日	9,440.00	2,000.00	14	3.4 0	12.48	-	-
东方 证 券	20220927000246 31	中 际 旭 创	202 2 年 09 月 27	55,120.00	2,000.00	14	3.4 0	72.88	-	-

			日							
东方证券	2022092700024661	国瓷材料	2022年09月27日	31,230.00	1,000.00	14	3.40	41.29	-	-
东方证券	2022092700024701	华测检测	2022年09月27日	42,200.00	2,000.00	14	3.40	55.80	-	-
东方证券	2022092700024705	光环新网	2022年09月27日	16,760.00	2,000.00	14	3.40	22.16	-	-
东方证券	2022092700024715	景嘉微	2022年09月27日	48,110.00	1,000.00	14	3.40	63.61	-	-
东方证券	2022092700028187	万达信息	2022年09月27日	7,760.00	1,000.00	14	3.50	10.56	-	-
东方证券	2022092700028189	易华录	2022年09月27日	25,213.00	1,900.00	14	3.50	34.32	-	-
东	20220927000287	光	202	7,570.00	1,000.00	14	3.4	10.01	-	-

方证券	57	线传媒	2 年 09 月 27 日				0			
东方证券	20220927000287 59	中际旭创	202 2 年 09 月 27 日	41,340.00	1,500.00	14	3.4 0	54.66	-	-
东方证券	20220927000287 83	我武生物	202 2 年 09 月 27 日	95,180.00	2,000.00	14	3.4 0	125.8 5	-	-
东方证券	20220927000289 13	中际旭创	202 2 年 09 月 27 日	27,560.00	1,000.00	14	3.4 0	36.44	-	-
东方证券	20220927000290 15	光威复材	202 2 年 09 月 27 日	175,920.0 0	2,000.00	14	3.4 0	232.6 1	-	-
东方证券	20220927000290 57	昆仑万维	202 2 年 09 月 27 日	12,800.00	1,000.00	14	3.4 0	16.92	-	-
东方证	20220927000291 01	蓝色光	202 2 年	4,800.00	1,000.00	14	3.4 0	6.35	-	-

券		标	09 月 27 日							
东方证 券	20221010000012 74	九号公 司 - W D	202 2年 10月 10日	75,000.00	2,000.00	14	3.4 0	99.17	-	-
东方证 券	20221010001085 99	九号公 司 - W D	202 2年 10月 10日	75,000.00	2,000.00	14	3.4 0	99.17	-	-
东方证 券	20221011000235 45	华测 检测	202 2年 10月 11日	40,660.00	2,000.00	14	3.4 0	53.76	-	-
东方证 券	20221011000235 49	我武 生物	202 2年 10月 11日	47,320.00	1,000.00	14	3.4 0	62.57	-	-
东方证 券	20221011000239 71	信维 通信	202 2年 10月 11日	14,000.00	1,000.00	14	3.4 0	18.51	-	-
东方证 券	20221011000239 99	网宿 科技	202 2年 10月	4,620.00	1,000.00	14	3.4 0	6.11	-	-

			11 日							
东方证 券	20221011000240 03	长盈 精密	202 2年 10月 11日	10,330.00	1,000.00	14	3.4 0	13.66	-	-
东方证 券	20221011000247 75	稳健 医疗	202 2年 10月 11日	87,880.00	1,300.00	14	3.6 0	123.0 3	-	-
东方证 券	20221011000264 29	光线 传媒	202 2年 10月 11日	6,800.00	1,000.00	14	3.4 0	8.99	-	-
东方证 券	20221011000264 33	利亚 德	202 2年 10月 11日	5,420.00	1,000.00	14	3.4 0	7.17	-	-
东方证 券	20221011000264 59	华测 检测	202 2年 10月 11日	20,330.00	1,000.00	14	3.4 0	26.88	-	-
东方证 券	20221011000264 71	机器 人	202 2年 10月 11日	17,420.00	2,000.00	14	3.4 0	23.03	-	-

东方证券	2022101100026473	海新能科	2022年10月11日	8,160.00	2,000.00	14	3.40	10.79	-	-
东方证券	2022101100026475	海新能科	2022年10月11日	4,080.00	1,000.00	14	3.40	5.39	-	-
东方证券	2022101100026477	海新能科	2022年10月11日	4,080.00	1,000.00	14	3.40	5.39	-	-
东方证券	2022101100026481	信维通信	2022年10月11日	14,000.00	1,000.00	14	3.40	18.51	-	-
东方证券	2022101100026487	宋城演艺	2022年10月11日	10,880.00	1,000.00	14	3.40	14.39	-	-
东方证券	2022101100026503	网宿科技	2022年10月11日	9,240.00	2,000.00	14	3.40	12.22	-	-
东方	2022101100026505	网宿	2022	9,240.00	2,000.00	14	3.40	12.22	-	-

证券		科技	年 10 月 11 日							
东方证 券	20221011000265 15	卫 宁 健 康	202 2 年 10 月 11 日	6,790.00	1,000.00	14	3.4 0	8.98	-	-
东方证 券	20221011000265 17	蓝 色 光 标	202 2 年 10 月 11 日	8,860.00	2,000.00	14	3.4 0	11.71	-	-
东方证 券	20221011000265 19	东 方 国 信	202 2 年 10 月 11 日	14,420.00	2,000.00	14	3.4 0	19.07	-	-
东方证 券	20221011000275 39	易 华 录	202 2 年 10 月 11 日	23,199.00	1,900.00	14	3.5 0	31.58	-	-
东方证 券	20221011000275 41	光 线 传 媒	202 2 年 10 月 11 日	6,800.00	1,000.00	14	3.4 0	8.99	-	-
东方证 券	20221011000275 43	中 际 旭 创	202 2 年 10 月 11 日	53,100.00	2,000.00	14	3.4 0	70.21	-	-

			月 11 日							
东方 证 券	20221011000275 45	中 际 旭 创	202 2 年 10 月 11 日	39,825.00	1,500.00	14	3.4 0	52.66	-	-
东方 证 券	20221011000275 47	中 际 旭 创	202 2 年 10 月 11 日	26,550.00	1,000.00	14	3.4 0	35.11	-	-
东方 证 券	20221011000275 95	华 测 检 测	202 2 年 10 月 11 日	40,660.00	2,000.00	14	3.4 0	53.76	-	-
东方 证 券	20221011000276 01	我 武 生 物	202 2 年 10 月 11 日	94,640.00	2,000.00	14	3.4 0	125.1 4	-	-
东方 证 券	20221011000276 05	光 环 新 网	202 2 年 10 月 11 日	15,820.00	2,000.00	14	3.4 0	20.92	-	-
东方 证 券	20221011000276 25	景 嘉 微	202 2 年 10 月 11	44,850.00	1,000.00	14	3.4 0	59.30	-	-

			日							
东方证券	2022101100027691	光威复材	2022年10月11日	157,040.00	2,000.00	14	3.40	207.64	-	-
东方证券	2022101100027693	昆仑万维	2022年10月11日	12,160.00	1,000.00	14	3.40	16.08	-	-
东方证券	2022101100027703	蓝色光标	2022年10月11日	4,430.00	1,000.00	14	3.40	5.86	-	-
东方证券	2022101100027715	国瓷材料	2022年10月11日	26,450.00	1,000.00	14	3.40	34.97	-	-
东方证券	2022101100027721	万达信息	2022年10月11日	7,340.00	1,000.00	14	3.50	9.99	-	-
招商证券	2022102400002800	红日药业	2022年10月24日	157,750.00	25,000.00	14	3.50	214.72	-	-
东	20221024000795	九	202	87,940.00	2,000.00	14	3.4	116.2	-	-

方 证 券	23	号 公 司 - W D	2 年 10 月 24 日				0	8		
东 方 证 券	20221025000224 44	机 器 人	202 2 年 10 月 25 日	18,100.00	2,000.00	14	3.4 0	23.93	-	-
东 方 证 券	20221025000224 52	蓝 色 光 标	202 2 年 10 月 25 日	8,860.00	2,000.00	14	3.4 0	11.71	-	-
东 方 证 券	20221025000224 58	蓝 色 光 标	202 2 年 10 月 25 日	4,430.00	1,000.00	14	3.4 0	5.86	-	-
东 方 证 券	20221025000231 80	卫 宁 健 康	202 2 年 10 月 25 日	8,740.00	1,000.00	14	3.4 0	11.56	-	-
东 方 证 券	20221025000231 96	网 宿 科 技	202 2 年 10 月 25 日	9,680.00	2,000.00	14	3.4 0	12.80	-	-
东 方 证 券	20221025000231 98	网 宿 科 技	202 2 年	4,840.00	1,000.00	14	3.4 0	6.40	-	-

券		技	10 月 25 日							
东方证 券	20221025000232 02	我武生 物	202 2 年 10 月 25 日	47,110.00	1,000.00	14	3.4 0	62.29	-	-
东方证 券	20221025000232 04	我武生 物	202 2 年 10 月 25 日	94,220.00	2,000.00	14	3.4 0	124.5 8	-	-
东方证 券	20221025000238 68	中际旭 创	202 2 年 10 月 25 日	55,480.00	2,000.00	14	3.4 0	73.36	-	-
东方证 券	20221025000238 70	中际旭 创	202 2 年 10 月 25 日	41,610.00	1,500.00	14	3.4 0	55.02	-	-
东方证 券	20221025000239 32	华测检 测	202 2 年 10 月 25 日	37,460.00	2,000.00	14	3.4 0	49.53	-	-
东方证 券	20221025000239 34	华测检 测	202 2 年 10 月	37,460.00	2,000.00	14	3.4 0	49.53	-	-

			25 日							
东方证 券	20221025000239 38	稳 健 医 疗	202 2 年 10 月 25 日	88,348.00	1,300.00	14	3.6 0	123.6 9	-	-
东方证 券	20221025000264 44	万 达 信 息	202 2 年 10 月 25 日	7,930.00	1,000.00	14	3.5 0	10.79	-	-
东方证 券	20221025000264 48	光 线 传 媒	202 2 年 10 月 25 日	6,660.00	1,000.00	14	3.4 0	8.81	-	-
东方证 券	20221025000264 62	国 瓷 材 料	202 2 年 10 月 25 日	22,540.00	1,000.00	14	3.4 0	29.80	-	-
东方证 券	20221025000264 70	景 嘉 微	202 2 年 10 月 25 日	51,750.00	1,000.00	14	3.4 0	68.43	-	-
东方证 券	20221025000264 72	海 新 能 科	202 2 年 10 月 25 日	4,210.00	1,000.00	14	3.4 0	5.57	-	-

东方证券	2022102500026492	宋城演艺	2022年10月25日	11,290.00	1,000.00	14	3.40	14.93	-	-
东方证券	2022102500026516	信维通信	2022年10月25日	14,820.00	1,000.00	14	3.40	19.60	-	-
东方证券	2022102500026588	长盈精密	2022年10月25日	12,430.00	1,000.00	14	3.40	16.44	-	-
东方证券	2022102500026654	信维通信	2022年10月25日	14,820.00	1,000.00	14	3.40	19.60	-	-
东方证券	2022102500028962	易华录	2022年10月25日	24,928.00	1,900.00	14	3.50	33.93	-	-
东方证券	2022102500028974	光线传媒	2022年10月25日	6,660.00	1,000.00	14	3.40	8.81	-	-
东方	2022102500028982	网宿	2022	9,680.00	2,000.00	14	3.40	12.80	-	-

证券		科技	年 10 月 25 日							
东方证券	20221025000289 94	光环新网	202 2 年 10 月 25 日	16,520.00	2,000.00	14	3.4 0	21.84	-	-
东方证券	20221025000290 34	利亚德	202 2 年 10 月 25 日	5,620.00	1,000.00	14	3.4 0	7.43	-	-
东方证券	20221025000290 46	昆仑万维	202 2 年 10 月 25 日	12,680.00	1,000.00	14	3.4 0	16.77	-	-
东方证券	20221025000290 56	海新能科	202 2 年 10 月 25 日	8,420.00	2,000.00	14	3.4 0	11.13	-	-
东方证券	20221025000292 62	海新能科	202 2 年 10 月 25 日	4,210.00	1,000.00	14	3.4 0	5.57	-	-
东方证券	20221025000293 24	东方国信	202 2 年 10 月 25 日	15,680.00	2,000.00	14	3.4 0	20.73	-	-

			月 25 日							
东方 证 券	20221025000293 28	中 际 旭 创	202 2 年 10 月 25 日	27,740.00	1,000.00	14	3.4 0	36.68	-	-
东方 证 券	20221025000294 36	光 威 复 材	202 2 年 10 月 25 日	160,400.0 0	2,000.00	14	3.4 0	212.0 8	-	-
东方 证 券	20221025000294 50	华 测 检 测	202 2 年 10 月 25 日	18,730.00	1,000.00	14	3.4 0	24.77	-	-
招商 证 券	20221031000010 25	红 日 药 业	202 2 年 10 月 31 日	62,304.00	8,800.00	14	3.5 0	84.80	-	-
东方 证 券	20221107000887 67	九 号 公 司 - W D	202 2 年 11 月 07 日	68,200.00	2,000.00	14	3.4 0	90.18	-	-
招商 证 券	20221107000941 81	红 日 药 业	202 2 年 11 月 07	162,750.0 0	25,000.0 0	14	3.5 0	221.5 2	-	-

			日							
东方证券	2022110800022503	机器人	2022年11月08日	19,100.00	2,000.00	14	3.50	26.00	-	-
东方证券	2022110800023841	信维通信	2022年11月08日	17,070.00	1,000.00	14	3.40	22.57	-	-
东方证券	2022110800023843	信维通信	2022年11月08日	17,070.00	1,000.00	14	3.40	22.57	-	-
东方证券	2022110800023849	长盈精密	2022年11月08日	13,060.00	1,000.00	14	3.40	17.27	-	-
东方证券	2022110800023851	网宿科技	2022年11月08日	11,160.00	2,000.00	14	3.40	14.76	-	-
东方证券	2022110800023931	光环新网	2022年11月08日	17,720.00	2,000.00	14	3.40	23.43	-	-
东	20221108000251	蓝	202	5,470.00	1,000.00	14	3.4	7.23	-	-

方证券	27	色光标	2 年 11 月 08 日				0			
东方证券	20221108000251 47	中际旭创	202 2 年 11 月 08 日	59,800.00	2,000.00	14	3.4 0	79.07	-	-
东方证券	20221108000251 69	华测检测	202 2 年 11 月 08 日	41,220.00	2,000.00	14	3.4 0	54.50	-	-
东方证券	20221108000256 33	光威复材	202 2 年 11 月 08 日	147,280.0 0	2,000.00	14	3.4 0	194.7 4	-	-
东方证券	20221108000256 59	海新能科	202 2 年 11 月 08 日	4,280.00	1,000.00	14	3.4 0	5.66	-	-
东方证券	20221108000256 61	利亚德	202 2 年 11 月 08 日	6,050.00	1,000.00	14	3.4 0	8.00	-	-
东方证	20221108000256 65	东方国	202 2 年	17,460.00	2,000.00	14	3.4 0	23.09	-	-

券		信	11 月 08 日							
东方证 券	20221108000257 25	中 际 旭 创	202 2 年 11 月 08 日	29,900.00	1,000.00	14	3.4 0	39.53	-	-
东方证 券	20221108000257 73	光 线 传 媒	202 2 年 11 月 08 日	7,470.00	1,000.00	14	3.4 0	9.88	-	-
东方证 券	20221108000289 07	国 瓷 材 料	202 2 年 11 月 08 日	27,170.00	1,000.00	14	3.4 0	35.92	-	-
东方证 券	20221108000293 67	易 华 录	202 2 年 11 月 08 日	33,421.00	1,900.00	14	3.6 0	46.79	-	-
东方证 券	20221108000294 65	稳 健 医 疗	202 2 年 11 月 08 日	88,725.00	1,300.00	14	3.6 0	124.2 2	-	-
东方证 券	20221108000295 41	蓝 色 光 标	202 2 年 11 月	10,940.00	2,000.00	14	3.4 0	14.47	-	-

			08 日							
东方证 券	20221108000297 63	海 新 能 科	202 2 年 11 月 08 日	8,560.00	2,000.00	14	3.4 0	11.32	-	-
东方证 券	20221108000297 65	海 新 能 科	202 2 年 11 月 08 日	4,280.00	1,000.00	14	3.4 0	5.66	-	-
东方证 券	20221108000297 81	卫 宁 健 康	202 2 年 11 月 08 日	9,440.00	1,000.00	14	3.4 0	12.48	-	-
东方证 券	20221108000298 15	景 嘉 微	202 2 年 11 月 08 日	65,000.00	1,000.00	14	3.4 0	85.94	-	-
东方证 券	20221108000298 59	华 测 检 测	202 2 年 11 月 08 日	20,610.00	1,000.00	14	3.4 0	27.25	-	-
东方证 券	20221108000298 81	华 测 检 测	202 2 年 11 月 08 日	41,220.00	2,000.00	14	3.4 0	54.50	-	-

东方证券	2022110800029927	昆仑万维	2022年11月08日	13,670.00	1,000.00	14	3.40	18.07	-	-
东方证券	2022110800030169	网宿科技	2022年11月08日	11,160.00	2,000.00	14	3.40	14.76	-	-
东方证券	2022110800030171	网宿科技	2022年11月08日	5,580.00	1,000.00	14	3.40	7.38	-	-
东方证券	2022110800030309	中际旭创	2022年11月08日	44,850.00	1,500.00	14	3.40	59.30	-	-
东方证券	2022110800030635	我武生物	2022年11月08日	102,380.00	2,000.00	14	3.40	135.37	-	-
东方证券	2022110800030703	宋城演艺	2022年11月08日	13,230.00	1,000.00	14	3.40	17.49	-	-
东方	2022110800030725	万达	2022	9,110.00	1,000.00	14	3.50	12.40	-	-

证券		信息	年 11 月 08 日							
东方证 券	20221108000307 27	光线 传媒	202 2 年 11 月 08 日	7,470.00	1,000.00	14	3.4 0	9.88	-	-
东方证 券	20221108000307 87	我武 生物	202 2 年 11 月 08 日	51,190.00	1,000.00	14	3.4 0	67.68	-	-
东方证 券	20221114000009 25	中国 通号	202 2 年 11 月 14 日	221,214.0 0	48,300.0 0	14	3.4 0	292.4 9	-	-
东方证 券	20221114000009 29	九号 公司 - W D	202 2 年 11 月 14 日	155,711.0 0	4,700.00	14	3.4 0	205.8 8	-	-
东方证 券	20221114000009 33	晶晨 股份	202 2 年 11 月 14 日	145,475.0 0	2,300.00	14	3.4 0	192.3 5	-	-
东方证 券	20221114000009 35	中控 技术	202 2 年 11	495,275.0 0	5,500.00	14	3.4 0	654.8 6	-	-

			月 14 日							
东方 证 券	2022111400009 39	西 部 超 导	202 2 年 11 月 14 日	510,000.0 0	5,000.00	14	3.4 0	674.3 3	-	-
招 商 证 券	20221114000075 97	红 日 药 业	202 2 年 11 月 14 日	62,128.00	8,800.00	14	3.5 0	84.56	-	-
东 方 证 券	20221121000825 40	九 号 公 司 - W D	202 2 年 11 月 21 日	66,900.00	2,000.00	14	3.4 0	88.46	-	-
东 方 证 券	20221122000169 93	长 盈 精 密	202 2 年 11 月 22 日	12,180.00	1,000.00	14	3.4 0	16.10	-	-
东 方 证 券	20221122000170 27	中 际 旭 创	202 2 年 11 月 22 日	58,900.00	2,000.00	14	3.4 0	77.88	-	-
东 方 证 券	20221122000170 41	华 测 检 测	202 2 年 11 月 22	21,410.00	1,000.00	14	3.4 0	28.31	-	-

			日							
东方证券	2022112200017043	华测检测	2022年11月22日	42,820.00	2,000.00	14	3.40	56.62	-	-
东方证券	2022112200017067	中际旭创	2022年11月22日	29,450.00	1,000.00	14	3.40	38.94	-	-
东方证券	2022112200017077	中际旭创	2022年11月22日	44,175.00	1,500.00	14	3.40	58.41	-	-
东方证券	2022112200017079	东方国信	2022年11月22日	17,900.00	2,000.00	14	3.40	23.67	-	-
东方证券	2022112200017089	光威复材	2022年11月22日	148,100.00	2,000.00	14	3.40	195.82	-	-
东方证券	2022112200017097	网宿科技	2022年11月22日	11,220.00	2,000.00	14	3.40	14.84	-	-
东	20221122000170	网	202	5,610.00	1,000.00	14	3.4	7.42	-	-

方 证 券	99	宿 科 技	2 年 11 月 22 日				0			
东 方 证 券	20221122000171 03	稳 健 医 疗	202 2 年 11 月 22 日	87,373.00	1,300.00	14	3.6 0	122.3 2	-	-
东 方 证 券	20221122000171 13	信 维 通 信	202 2 年 11 月 22 日	17,150.00	1,000.00	14	3.4 0	22.68	-	-
东 方 证 券	20221122000171 15	信 维 通 信	202 2 年 11 月 22 日	17,150.00	1,000.00	14	3.4 0	22.68	-	-
东 方 证 券	20221122000171 19	光 线 传 媒	202 2 年 11 月 22 日	7,530.00	1,000.00	14	3.4 0	9.96	-	-
东 方 证 券	20221122000183 39	利 亚 德	202 2 年 11 月 22 日	5,990.00	1,000.00	14	3.4 0	7.92	-	-
东 方 证 券	20221122000183 47	光 环 新	202 2 年	18,000.00	2,000.00	14	3.4 0	23.80	-	-

券		网	11 月 22 日							
东方证 券	20221122000183 59	蓝色 光标	202 2 年 11 月 22 日	11,400.00	2,000.00	14	3.4 0	15.07	-	-
东方证 券	20221122000183 63	蓝色 光标	202 2 年 11 月 22 日	5,700.00	1,000.00	14	3.4 0	7.54	-	-
东方证 券	20221122000183 65	海新 能科	202 2 年 11 月 22 日	4,290.00	1,000.00	14	3.4 0	5.67	-	-
东方证 券	20221122000183 67	海新 能科	202 2 年 11 月 22 日	8,580.00	2,000.00	14	3.4 0	11.34	-	-
东方证 券	20221122000183 69	海新 能科	202 2 年 11 月 22 日	4,290.00	1,000.00	14	3.4 0	5.67	-	-
东方证 券	20221122000193 09	景嘉 微	202 2 年 11 月	60,980.00	1,000.00	14	3.4 0	80.63	-	-

			22 日							
东方证 券	20221122000193 77	华 测 检 测	202 2 年 11 月 22 日	42,820.00	2,000.00	14	3.4 0	56.62	-	-
东方证 券	20221122000193 95	宋 城 演 艺	202 2 年 11 月 22 日	12,800.00	1,000.00	14	3.4 0	16.92	-	-
东方证 券	20221122000194 15	网 宿 科 技	202 2 年 11 月 22 日	11,220.00	2,000.00	14	3.4 0	14.84	-	-
东方证 券	20221122000194 29	机 器 人	202 2 年 11 月 22 日	19,760.00	2,000.00	14	3.5 0	26.90	-	-
东方证 券	20221122000194 45	我 武 生 物	202 2 年 11 月 22 日	102,060.0 0	2,000.00	14	3.4 0	134.9 5	-	-
东方证 券	20221122000194 47	我 武 生 物	202 2 年 11 月 22 日	51,030.00	1,000.00	14	3.4 0	67.47	-	-

东方证券	2022112200019451	万达信息	2022年11月22日	9,310.00	1,000.00	14	3.50	12.67	-	-
东方证券	2022112200019453	光线传媒	2022年11月22日	7,530.00	1,000.00	14	3.40	9.96	-	-
东方证券	2022112200019455	易华录	2022年11月22日	39,406.00	1,900.00	14	3.60	55.17	-	-
东方证券	2022112200019477	国瓷材料	2022年11月22日	28,400.00	1,000.00	14	3.40	37.55	-	-
东方证券	2022112200021213	卫宁健康	2022年11月22日	9,520.00	1,000.00	14	3.40	12.59	-	-
东方证券	2022112200022103	昆仑万维	2022年11月22日	14,470.00	1,000.00	14	3.40	19.13	-	-
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日										
关	合约编号	证	成	交易金额	交易数量	出	费	利息	期	期

联 方 名 称	券 名 称	交 时 间	(单 位: 股)	借 期 限 (单 位: 天)	率	收 入	未 证 券 出 借 业 务 余 额	未 应 收 利 息 余 额
			-	-	-	-	-	-

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自有资金投资本基金的情况

注： 本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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

注： 本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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

注： 本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额，本报告期及上年度可比期间均未有由关联方保管银行存款而产生的利息收入。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注： 本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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

注： 本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

7.4.12 期末 (2022 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	受 限 期	流 通 受 受	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

称				限类型			股)			
301265	华新环保	2022年12月08日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	806	10,703.68	9,188.40	
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300850	新强联	2022年12月30日	重大事项停牌	53.28	2023年01月10日	56.88	12,200	733,508.00	650,016.00	
600038	中直股份	2022年12月26日	重大事项停	46.41	2023年01月10日	51.05	18,200	949,308.01	844,662.00	

		日	牌		日				
--	--	---	---	--	---	--	--	--	--

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

注：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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: 张)	期末估值总额
1	600157	永泰能源	2023年01月03日	2023年01月03日	1.53	380,000	581,400.00
2	300724	捷佳伟创	2023年01月09日	2023年01月09日	114.02	4,800	547,296.00
3	300003	乐普医疗	2023年01月03日	2023年01月03日	22.97	23,000	528,310.00
4	002422	科伦药业	2023年01月09日	2023年01月09日	26.61	19,700	524,217.00
5	688063	派能科技	2023年01月03日	2023年01月03日	315.65	1,600	505,040.00
6	600096	云天化	2023年01月09日	2023年01月09日	21.04	22,400	471,296.00

7	600079	人福医药	2023年01月09日	-	2023年01月09日	23.89	19,700	470,633.00
8	002497	雅化集团	2023年01月09日	-	2023年01月09日	23.25	20,200	469,650.00
9	002603	以岭药业	2023年01月09日	-	2023年01月09日	29.96	14,600	437,416.00
10	601233	桐昆股份	2023年01月09日	-	2023年01月09日	14.45	29,100	420,495.00
11	600988	赤峰黄金	2023年01月03日	-	2023年01月03日	18.05	23,100	416,955.00
12	300390	天华超净	2023年01月09日	-	2023年01月09日	55.88	7,200	402,336.00
13	600418	江淮汽车	2023年01月09日	-	2023年01月09日	13.13	30,100	395,213.00
14	600141	兴发集团	2023年01月09日	-	2023年01月09日	29.00	13,600	394,400.00
15	300699	光威复材	2023年01月09日	-	2023年01月09日	72.25	5,400	390,150.00
16	688390	固德威电源	2023年01月09日	-	2023年01月09日	323.09	1,200	387,708.00
17	000807	云铝股	2023年01月03日	-	2023年01月03日	11.12	34,500	383,640.00

		份	日	日			
18	300568	星源材质	2023年01月09日	2023年01月09日	21.26	18,000	382,680.00
19	600487	亨通光电	2023年01月03日	2023年01月03日	15.06	24,400	367,464.00
20	002185	华天科技	2023年01月03日	2023年01月03日	8.29	44,300	367,247.00
21	000009	中国宝安	2023年01月09日	2023年01月09日	12.09	30,000	362,700.00
22	000629	钒钛股份	2023年01月03日	2023年01月09日	4.73	75,400	356,642.00
23	000683	远兴能源	2023年01月09日	2023年01月09日	7.84	44,800	351,232.00
24	601699	潞安环能	2023年01月03日	2023年01月03日	16.85	20,700	348,795.00
25	002223	鱼跃医疗	2023年01月03日	2023年01月03日	31.86	10,500	334,530.00
26	000831	中国稀土	2023年01月09日	2023年01月09日	32.88	10,100	332,088.00
27	603077	和邦生物	2023年01月09日	2023年01月09日	3.04	108,700	330,448.00
28	002078	太阳纸	2023年01月09日	2023年01月09日	11.52	28,500	328,320.00

		业	日	日			
29	688385	复旦 微电	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	69.81	4,500 314,145.00
30	002532	天山 铝业	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	7.72	40,600 313,432.00
31	002624	完美 世界	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.72	23,700 301,464.00
32	600705	中航 产融	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	3.28	90,700 297,496.00
33	600258	首旅 酒店	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	24.80	11,500 285,200.00
34	300308	中际 旭创	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	27.03	9,900 267,597.00
35	601016	节能 风电	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	3.81	69,100 263,271.00
36	002739	万达 电影	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.00	18,800 263,200.00
37	600704	物产 中大	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.81	54,600 262,626.00
38	600655	豫园 股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	7.61	34,500 262,545.00
39	002138	顺络 电	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	26.18	10,000 261,800.00

		子	日	日				
40	600879	航 天 电 子	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.80	38,100	259,080.00
41	000400	许 继 电 气	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	19.97	12,300	245,631.00
42	000878	云 南 铜 业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.75	20,800	244,400.00
43	600516	方 大 炭 素	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.12	39,400	241,128.00
44	002444	巨 星 科 技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	18.98	12,700	241,046.00
45	002531	天 顺 风 能	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	15.13	15,700	237,541.00
46	002326	永 太 科 技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	21.83	10,800	235,764.00
47	002372	伟 星 新 材	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	21.34	11,000	234,740.00
48	000975	银 泰 黄 金	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	11.04	21,200	234,048.00
49	600380	健 康 元	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.29	20,400	230,316.00
50	600056	中 国 医	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	17.23	13,300	229,159.00

		药	日	日				
51	689009	九号公司	2023年01月09日	-	2023年01月09日	30.49	7,500	228,675.00
52	000591	太阳能	2023年01月09日	-	2023年01月09日	7.33	30,900	226,497.00
53	600673	东阳光	2023年01月09日	-	2023年01月09日	8.69	25,800	224,202.00
54	600118	中国卫星	2023年01月09日	-	2023年01月09日	21.55	10,400	224,120.00
55	600985	淮北矿业	2023年01月03日	-	2023年01月03日	12.80	17,000	217,600.00
56	601880	辽港股份	2023年01月09日	-	2023年01月09日	1.62	133,500	216,270.00
57	600008	首创环保	2023年01月09日	-	2023年01月09日	2.83	76,100	215,363.00
58	300026	红日药业	2023年01月03日	-	2023年01月03日	5.68	37,200	211,296.00
59	000547	航天发展	2023年01月03日	-	2023年01月03日	9.39	22,500	211,275.00
60	300070	碧水源	2023年01月09日	-	2023年01月09日	4.73	44,200	209,066.00
61	000027	深圳能	2023年01月09日	-	2023年01月09日	6.36	32,600	207,336.00

		源	日	日				
62	000636	风华高科	2023年01月09日	-	2023年01月09日	14.83	13,800	204,654.00
63	300682	朗新科技	2023年01月09日	-	2023年01月09日	21.98	9,300	204,414.00
64	002572	索菲亚	2023年01月03日	-	2023年01月03日	18.16	11,100	201,576.00
65	002195	二三四五	2023年01月09日	-	2023年01月09日	2.01	100,000	201,000.00
66	002212	天融信	2023年01月09日	-	2023年01月09日	9.99	20,100	200,799.00
67	300296	利亚德	2023年01月03日	-	2023年01月09日	5.66	35,400	200,364.00
68	600580	卧龙电驱	2023年01月09日	-	2023年01月09日	12.46	16,000	199,360.00
69	600021	上海电力	2023年01月09日	-	2023年01月09日	10.01	19,900	199,199.00
70	002183	怡亚通	2023年01月09日	-	2023年01月09日	6.43	30,800	198,044.00
71	600390	五矿资本	2023年01月03日	-	2023年01月03日	5.08	38,500	195,580.00
72	000887	中鼎股	2023年01月09日	-	2023年01月09日	14.47	13,500	195,345.00

		份	日	日			
73	600208	新湖中宝	2023年01月09日	2023年01月09日	2.54	76,600	194,564.00
74	600755	厦门国贸	2023年01月09日	2023年01月09日	7.14	27,200	194,208.00
75	300024	机器人	2023年01月03日	2023年01月03日	8.98	21,500	193,070.00
76	601231	环旭电子	2023年01月03日	2023年01月03日	16.23	11,700	189,891.00
77	002155	湖南黄金	2023年01月09日	2023年01月09日	12.95	14,600	189,070.00
78	603885	吉祥航空	2023年01月09日	2023年01月09日	16.18	11,600	187,688.00
79	600415	小商品城	2023年01月09日	2023年01月09日	5.24	35,800	187,592.00
80	300850	新强联	2023年01月03日	2023年01月03日	53.28	3,500	186,480.00
81	601717	郑煤机	2023年01月03日	2023年01月03日	11.16	15,800	176,328.00
82	002939	长城证券	2023年01月09日	2023年01月09日	8.28	21,100	174,708.00
83	000050	深天马	2023年01月09日	2023年01月09日	8.66	20,000	173,200.00

		A	日	日				
84	000021	深科技	2023年01月03日	-	2023年01月03日	10.69	16,200	173,178.00
85	601866	中远海发	2023年01月03日	-	2023年01月03日	2.42	70,700	171,094.00
86	600906	财达证券	2023年01月09日	-	2023年01月09日	7.57	22,300	168,811.00
87	600839	四川长虹	2023年01月09日	-	2023年01月09日	2.64	63,100	166,584.00
88	300251	光线传媒	2023年01月09日	-	2023年01月09日	8.66	19,200	166,272.00
89	300677	英科医疗	2023年01月09日	-	2023年01月09日	21.03	7,900	166,137.00
90	600500	中化国际	2023年01月03日	-	2023年01月03日	6.61	24,800	163,928.00
91	600663	陆家嘴	2023年01月03日	-	2023年01月03日	9.74	16,800	163,632.00
92	002127	南极电商	2023年01月09日	-	2023年01月09日	4.81	33,900	163,059.00
93	000987	越秀资本	2023年01月09日	-	2023年01月09日	5.99	27,000	161,730.00
94	002019	亿帆医	2023年01月09日	-	2023年01月09日	12.25	12,900	158,025.00

		药	日	日			
95	600959	江苏有线	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.97	53,200 158,004.00
96	000598	兴蓉环境	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.89	32,200 157,458.00
97	300182	捷成股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	4.47	35,200 157,344.00
98	600143	金发科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.69	16,200 156,978.00
99	002701	奥瑞金	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	5.05	30,500 154,025.00
100	688208	道通科技	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	31.55	4,800 151,440.00
101	300888	稳健医疗	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	71.50	2,100 150,150.00
102	002131	利欧股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	1.77	84,500 149,565.00
103	600026	中远海能	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.05	12,200 147,010.00
104	600871	石化油服	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.98	73,600 145,728.00
105	600409	三友化	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.61	22,000 145,420.00

		工	日	日				
106	000883	湖北能源	2023年01月09日	-	2023年01月09日	4.20	34,500	144,900.00
107	002266	浙富控股	2023年01月09日	-	2023年01月09日	3.91	36,600	143,106.00
108	002002	鸿达兴业	2023年01月09日	-	2023年01月09日	3.24	44,100	142,884.00
109	603225	新凤鸣	2023年01月03日	-	2023年01月03日	10.88	13,100	142,528.00
110	000960	锡业股份	2023年01月09日	-	2023年01月09日	14.10	10,000	141,000.00
111	688690	纳微科技	2023年01月09日	-	2023年01月09日	51.77	2,700	139,779.00
112	002505	鹏都农牧	2023年01月09日	-	2023年01月09日	2.58	54,100	139,578.00
113	000089	深圳机场	2023年01月03日	-	2023年01月03日	7.86	17,700	139,122.00
114	601333	广深铁路	2023年01月09日	-	2023年01月09日	2.27	60,800	138,016.00
115	600567	山鹰国际	2023年01月09日	-	2023年01月09日	2.48	55,500	137,640.00
116	600153	建发股	2023年01月03日	-	2023年01月03日	13.65	10,000	136,500.00

		份	日	日				
117	002468	申 通 快 递	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.33	13,200	136,356.00
118	002010	传 化 智 联	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.34	25,300	135,102.00
119	000656	金 科 股 份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.91	69,800	133,318.00
120	002429	兆 驰 股 份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.49	38,100	132,969.00
121	002745	木 林 森	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.11	16,100	130,571.00
122	300168	万 达 信 息	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.43	15,400	129,822.00
123	002191	劲 嘉 股 份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.23	17,900	129,417.00
124	600376	首 开 股 份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.69	22,600	128,594.00
125	600728	佳 都 科 技	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.28	24,200	127,776.00
126	600155	华 创 阳 安	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.50	19,200	124,800.00
127	688029	南 微 医	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	82.13	1,500	123,195.00

		学科技	日	日				
128	601991	大唐发电	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	2.79	43,800	122,202.00
129	002416	爱施德	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.48	12,800	121,344.00
130	002221	东华能源	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.63	15,800	120,554.00
131	601568	北元集团	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	5.67	19,800	112,266.00
132	003035	南网能源	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.67	19,200	108,864.00
133	000559	万向钱潮	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.87	22,300	108,601.00
134	600095	湘财股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.56	14,300	108,108.00
135	601611	中国核建	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.60	14,100	107,160.00
136	000709	河钢股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	2.26	47,400	107,124.00
137	000959	首钢股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	3.77	28,100	105,937.00
138	300630	普	2023	-	2023	24.66	4,100	101,106.00

		利 制 药	年 01 月 03 日	年 01 月 03 日			
139	600556	天 下 秀	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.74	14,900	100,426.00
140	601058	赛 轮 胎	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 03 日	10.02	10,000	100,200.00
141	600167	联 美 控 股	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.32	15,700	99,224.00
142	002434	万 里 扬	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.05	12,200	98,210.00
143	600707	彩 虹 股 份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.14	23,700	98,118.00
144	002948	青 岛 银 行	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.36	29,200	98,112.00
145	000415	渤 海 租 赁	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.21	44,300	97,903.00
146	601828	美 凯 龙	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.69	18,900	88,641.00
147	300869	康 泰 医 学	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	32.57	2,700	87,939.00
148	688006	浙 江 杭 可 科	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	43.77	2,000	87,540.00

		技						
149	601778	晶 科 科 技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.50	15,400	84,700.00
150	601969	海 南 矿 业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.41	11,200	82,992.00
151	300058	蓝 色 光 标	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	5.05	16,100	81,305.00
152	000031	大 悦 城	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.76	21,300	80,088.00
153	600006	东 风 汽 车	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.58	13,100	73,098.00
154	000961	中 南 建 设	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.19	33,000	72,270.00
155	600787	中 储 股 份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.97	14,500	72,065.00
156	601718	际 华 集 团	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	2.91	23,500	68,385.00
157	000540	中 天 金 融	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.51	42,200	63,722.00
158	601158	重 庆 水 务	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.13	11,000	56,430.00
159	601228	广 州 港	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.15	17,500	55,125.00

			日	日			
160	600667	太极实业	2023年01月03日	2023年01月03日	5.16	10,000	51,600.00
161	600928	西安银行	2023年01月03日	2023年01月03日	3.52	12,200	42,944.00
162	600863	内蒙华电	2023年01月03日	2023年01月03日	3.49	10,000	34,900.00
163	600297	广汇汽车	2023年01月03日	2023年01月03日	2.10	10,000	21,000.00
合计	-	-	-	-	-	4,614,700	33,545,512.00

注：出借证券中如有其它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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交

收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融

工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	23,910,410.75	-	-	-	-	-	23,910,410.75
结算备付金	5,793,342.16	-	-	-	-	-	5,793,342.16
存出保证金	22,832.17	-	-	-	-	1,128,883.20	1,151,715.37
交易性金融资产	1,530,314.38	-	2,136,777.04	-	-	393,096,493.34	396,763,584.76
衍生金融	-	-	-	-	-	-	-

融资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	116,446.78	-	-	-	-	1,279,298.76	1,395,745.54
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	14,255.12	14,255.12
资产总计	31,373,346.24	-	2,136,777.04	-	-	395,518,930.42	429,029,053.70

负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	13.18	13.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,411,087.61	1,411,087.61
应付管理人报	-	-	-	-	-	179,978.11	179,978.11

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	35,995.60	35,995.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,199.37	30,199.37
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1,582.55	1,582.55
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	308,868.98	308,868.98
负债总计	-	-	-	-	-	1,967,725.40	1,967,725.40
利	31,373,346.2	-	2,136,777.0	-	-	393,551,205.0	427,061,328.3

率 敏 感 度 缺 口	4		4			2	0
上 年 度 末 202 1 年 12 月 31 日	1 个月以内	1 - 3 个 月	3 个月-1 年	1 - 5 年	5 年 以 上	不计息	合计
资 产							
银 行 存 款	23,719,024.89	-	-	-	-	-	23,719,024.89
结 算 备 付 金	8,101,772.97	-	-	-	-	-	8,101,772.97
存 出 保 证 金	65,490.48	-	-	-	-	1,601,107.20	1,666,597.68
交 易 性 金 融 资 产	-	-	138,547.20	-	-	371,126,184.49	371,264,731.69
衍 生 金 融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	186,673.78	-	-	-	-	1,964,690.78	2,151,364.56
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	20,747.72	20,747.72
资产总计	32,072,962.12	-	138,547.20	-	-	374,712,730.19	406,924,239.51
资产总计							
资产总计							

债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,184,614.79	2,184,614.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	167,256.94	167,256.94

应付托管费	-	-	-	-	-	33,451.36	33,451.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	28,730.40	28,730.40
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	47,920.79	47,920.79
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	353,783.72	353,783.72
负债总计	-	-	-	-	-	2,815,758.00	2,815,758.00
利率	32,072,962.12	-	138,547.20	-	-	371,896,972.19	404,108,481.51

敏 感 度 缺 口							
-----------------------	--	--	--	--	--	--	--

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变； 3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动； 4. 银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响； 5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	基准利率减少 25 个基点	2,164.67	83.96
	基准利率增加 25 个基点	-2,160.73	-83.84

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	393,096,493.34	92.05	371,126,184.49	91.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,667,091.42	0.86	138,547.20	0.03
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	396,763,584.76	92.91	371,264,731.69	91.87

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上涨 5%	19,945,841.41	19,072,019.74
	中证 500 指数下跌 5%	-19,945,841.41	-19,072,019.74

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产

或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	391,592,626.94	369,041,738.67
第二层次	5,161,769.42	1,019,930.05
第三层次	9,188.40	1,203,062.97
合计	396,763,584.76	371,264,731.69

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,203,062.97	1,203,062.97
当期购买	-	10,703.68	10,703.68
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,203,062.97	1,203,062.97
当期利得或损失总额	-	-1,515.28	-1,515.28
其中：计入损益的利得或损失	-	-1,515.28	-1,515.28
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	9,188.40	9,188.40

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益	-	-1,515.28	-1,515.28
项目	上年度可比同期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,045,705.09	2,045,705.09
当期购买	-	454,001.91	454,001.91
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,045,705.09	2,045,705.09
当期利得或损失总额	-	749,061.06	749,061.06
其中：计入损益的利得或损失	-	749,061.06	749,061.06
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,203,062.97	1,203,062.97
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动—公允价值变动损益	-	749,061.06	749,061.06

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	9,188.40	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.4326	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估	不可观察输入值		

		值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,203,062.97	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.3022-2.7417	负相关

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	393,096,493.34	91.62
	其中：股票	393,096,493.34	91.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,667,091.42	0.85
	其中：债券	3,667,091.42	0.85
	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	29,703,752.91	6.92
8	其他各项资产	2,561,716.03	0.60
9	合计	429,029,053.70	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 33,545,512.00 元，占

期末基金资产净值比例 7.85%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,763,000.00	0.88
B	采矿业	17,224,256.12	4.03
C	制造业	239,137,670.27	56.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,156,670.94	3.08
E	建筑业	3,492,135.00	0.82
F	批发和零售业	16,688,460.25	3.91
G	交通运输、仓储和邮政业	8,760,843.03	2.05
H	住宿和餐饮业	1,029,200.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,134,157.49	6.59
J	金融业	34,210,551.68	8.01
K	房地产业	8,079,870.56	1.89
L	租赁和商务服务业	4,574,877.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	4,316,203.40	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,196,634.47	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	779,055.13	0.18
R	文化、体育和娱乐业	5,196,878.00	1.22
S	综合	2,346,841.60	0.55
	合计	393,087,304.94	92.04

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,188.40	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,188.40	0.00

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002340	格林美	317,100	2,356,053.00	0.55
2	300012	华测检测	103,700	2,312,510.00	0.54
3	600157	永泰能源	1,372,700	2,100,231.00	0.49
4	002384	东山精密	84,500	2,089,685.00	0.49
5	300724	捷佳伟创	17,200	1,961,144.00	0.46
6	688777	中控技术	21,544	1,956,841.52	0.46
7	688122	西部超导	20,122	1,905,352.18	0.45
8	603613	国联股份	21,520	1,903,228.80	0.45
9	300003	乐普医疗	81,300	1,867,461.00	0.44
10	002422	科伦药业	69,900	1,860,039.00	0.44
11	600487	亨通光电	121,900	1,835,814.00	0.43
12	688063	派能科技	5,800	1,830,770.00	0.43

13	002385	大北农	204,400	1,819,160.00	0.43
14	603345	安井食品	10,900	1,764,492.00	0.41
15	002966	苏州银行	226,340	1,760,925.20	0.41
16	603606	东方电缆	25,500	1,729,665.00	0.41
17	600885	宏发股份	51,518	1,721,216.38	0.40
18	600765	中航重机	54,520	1,695,026.80	0.40
19	600079	人福医药	70,600	1,686,634.00	0.39
20	600096	云天化	79,400	1,670,576.00	0.39
21	002497	雅化集团	71,100	1,653,075.00	0.39
22	601555	东吴证券	247,490	1,616,109.70	0.38
23	600352	浙江龙盛	160,800	1,591,920.00	0.37
24	002625	光启技术	93,200	1,586,264.00	0.37
25	002407	多氟多	47,400	1,579,368.00	0.37
26	002603	以岭药业	51,560	1,544,737.60	0.36
27	000009	中国宝安	127,340	1,539,540.60	0.36
28	601058	赛轮轮胎	151,300	1,516,026.00	0.35
29	002738	中矿资源	22,700	1,513,182.00	0.35
30	601233	桐昆股份	104,300	1,507,135.00	0.35
31	688390	固德威电源	4,620	1,492,675.80	0.35
32	600988	赤峰黄金	82,100	1,481,905.00	0.35
33	600489	中金黄金	179,600	1,470,924.00	0.34
34	603688	石英股份	11,200	1,470,784.00	0.34
35	603605	珀莱雅	8,700	1,457,076.00	0.34
36	600298	安琪酵母	32,200	1,456,084.00	0.34

		母			
37	002028	思源电 气	37,877	1,447,658.94	0.34
38	300146	汤臣倍 健	63,100	1,439,942.00	0.34
39	000807	云铝股 份	128,600	1,430,032.00	0.33
40	601108	财通证 券	200,650	1,428,628.00	0.33
41	600536	中国软 件	24,408	1,423,718.64	0.33
42	603939	益丰药 房	22,300	1,423,632.00	0.33
43	300390	天华超 净	25,400	1,419,352.00	0.33
44	600418	江淮汽 车	107,800	1,415,414.00	0.33
45	300144	宋城演 艺	96,900	1,414,740.00	0.33
46	300073	当升科 技	25,000	1,410,000.00	0.33
47	300037	新宙邦	32,060	1,393,648.20	0.33
48	600141	兴发集 团	48,040	1,393,160.00	0.33
49	600399	抚顺特 钢	97,300	1,392,363.00	0.33
50	300699	光威复 材	19,200	1,387,200.00	0.32
51	600859	王府井	49,002	1,378,916.28	0.32
52	603517	绝味食 品	22,500	1,374,525.00	0.32
53	300285	国瓷材 料	49,600	1,367,472.00	0.32
54	601077	渝农商 行	382,800	1,351,284.00	0.32
55	300568	星源材 质	63,300	1,345,758.00	0.32
56	000630	铜陵有 色	430,800	1,344,096.00	0.31
57	600873	梅花生 物	131,500	1,338,670.00	0.31
58	600563	法拉电 子	8,301	1,327,163.88	0.31

59	002185	华天科技	158,400	1,313,136.00	0.31
60	603456	九洲药业	30,900	1,311,087.00	0.31
61	002138	顺络电子	49,800	1,303,764.00	0.31
62	603816	顾家家居	30,500	1,302,655.00	0.31
63	600160	巨化股份	83,360	1,292,913.60	0.30
64	603589	口子窖	22,300	1,286,041.00	0.30
65	601128	常熟银行	169,000	1,275,950.00	0.30
66	000783	长江证券	239,100	1,274,403.00	0.30
67	600153	建发股份	92,700	1,265,355.00	0.30
68	000629	钒钛股份	265,800	1,257,234.00	0.29
69	688099	晶晨半导体	17,812	1,255,924.12	0.29
70	002192	融捷股份	12,800	1,253,120.00	0.29
71	605358	立昂微	29,300	1,248,180.00	0.29
72	300357	我武生物	22,600	1,245,260.00	0.29
73	601699	潞安环能	73,900	1,245,215.00	0.29
74	601162	天风证券	428,800	1,230,656.00	0.29
75	000683	远兴能源	156,800	1,229,312.00	0.29
76	601607	上海医药	68,600	1,223,138.00	0.29
77	603596	伯特利	15,200	1,212,960.00	0.28
78	600392	盛和资源	86,560	1,211,840.00	0.28
79	688567	孚能科技	44,800	1,210,944.00	0.28
80	002568	百润股份	32,400	1,210,464.00	0.28
81	600161	天坛生物	50,900	1,207,857.00	0.28

82	000932	华菱钢铁	255,880	1,202,636.00	0.28
83	600109	国金证券	138,000	1,200,600.00	0.28
84	601168	西部矿业	117,700	1,200,540.00	0.28
85	600521	华海药业	54,900	1,200,114.00	0.28
86	600499	科达制造	84,100	1,195,061.00	0.28
87	600486	扬农化工	11,500	1,194,850.00	0.28
88	000831	中国稀土	36,300	1,193,544.00	0.28
89	002223	鱼跃医疗	37,200	1,185,192.00	0.28
90	600027	华电国际	201,500	1,184,820.00	0.28
91	002797	第一创业	207,400	1,167,662.00	0.27
92	603077	和邦生物	382,300	1,162,192.00	0.27
93	688385	复旦微电	16,454	1,148,653.74	0.27
94	600862	中航高科	51,501	1,147,957.29	0.27
95	000999	华润三九	24,500	1,146,845.00	0.27
96	002078	太阳纸业	99,500	1,146,240.00	0.27
97	000975	银泰黄金	103,028	1,137,429.12	0.27
98	601636	旗滨集团	99,500	1,133,305.00	0.27
99	002294	信立泰	34,400	1,130,040.00	0.26
100	601872	招商轮船	200,600	1,121,354.00	0.26
101	002268	卫士通	36,530	1,115,260.90	0.26
102	600497	驰宏锌锗	220,000	1,113,200.00	0.26
103	002025	航天电器	16,800	1,113,000.00	0.26
104	600143	金发科	114,700	1,111,443.00	0.26

		技			
105	002532	天山铝业	143,800	1,110,136.00	0.26
106	002299	圣农发展	46,100	1,092,109.00	0.26
107	601696	中银证券	103,000	1,088,710.00	0.25
108	300253	卫宁健康	105,900	1,088,652.00	0.25
109	600177	雅戈尔	171,800	1,087,494.00	0.25
110	601990	南京证券	136,500	1,082,445.00	0.25
111	002439	启明星辰	41,200	1,074,496.00	0.25
112	600705	中航产融	327,000	1,072,560.00	0.25
113	002624	完美世界	83,800	1,065,936.00	0.25
114	000591	太阳能	144,700	1,060,651.00	0.25
115	600348	华阳股份	74,400	1,060,200.00	0.25
116	603737	三棵树	9,300	1,058,619.00	0.25
117	688301	奕瑞科技股份	2,300	1,053,124.00	0.25
118	000998	隆平高科	65,000	1,044,550.00	0.24
119	000738	航发控制	40,600	1,040,984.00	0.24
120	600026	中远海能	85,700	1,032,685.00	0.24
121	600549	厦门钨业	52,700	1,030,285.00	0.24
122	600258	首旅酒店	41,500	1,029,200.00	0.24
123	000728	国元证券	161,700	1,023,561.00	0.24
124	002850	科达利	8,600	1,021,766.00	0.24
125	600482	中国动力	66,800	1,021,372.00	0.24
126	000988	华工科技	62,100	1,019,061.00	0.24
127	000519	中兵红箭	51,600	1,013,424.00	0.24

128	002273	水晶光电	85,881	1,012,536.99	0.24
129	002673	西部证券	165,400	1,007,286.00	0.24
130	300604	长川科技	22,400	998,592.00	0.23
131	601997	贵阳银行	180,800	992,592.00	0.23
132	002507	涪陵榨菜	38,300	986,991.00	0.23
133	300136	信维通信	59,700	985,647.00	0.23
134	300832	新产业	19,500	977,730.00	0.23
135	300363	博腾股份	23,500	959,975.00	0.22
136	002092	中泰化学	128,500	958,610.00	0.22
137	000703	恒逸石化	136,100	956,783.00	0.22
138	002430	杭氧股份	24,300	956,448.00	0.22
139	600325	华发股份	104,800	949,488.00	0.22
140	002739	万达电影	67,400	943,600.00	0.22
141	002030	达安基因	60,595	942,858.20	0.22
142	002056	横店东磁	50,300	942,622.00	0.22
143	002557	洽洽食品	18,800	940,000.00	0.22
144	300308	中际旭创	34,600	935,238.00	0.22
145	600529	山东药玻	32,800	931,520.00	0.22
146	603233	大参林	23,460	929,016.00	0.22
147	601666	平煤股份	85,900	928,579.00	0.22
148	600704	物产中大	192,500	925,925.00	0.22
149	601198	东兴证券	119,900	925,628.00	0.22
150	000729	燕京啤	87,100	925,002.00	0.22

		酒			
151	002465	海格通信	113,900	924,868.00	0.22
152	002156	通富微电	56,000	922,880.00	0.22
153	601016	节能风电	241,650	920,686.50	0.22
154	600879	航天电子	134,600	915,280.00	0.21
155	600655	豫园股份	120,200	914,722.00	0.21
156	300088	长信科技	151,300	903,261.00	0.21
157	603658	安图生物	14,500	896,825.00	0.21
158	002080	中材科技	41,500	889,345.00	0.21
159	600546	山煤国际	61,200	886,788.00	0.21
160	600415	小商品城	169,200	886,608.00	0.21
161	002409	雅克科技	17,600	886,512.00	0.21
162	002353	杰瑞股份	31,741	885,891.31	0.21
163	000830	鲁西化工	71,293	883,320.27	0.21
164	688116	天奈科技	11,400	879,396.00	0.21
165	000878	云南铜业	74,200	871,850.00	0.20
166	000960	锡业股份	61,800	871,380.00	0.20
167	002683	广东宏大	32,300	870,808.00	0.20
168	000400	许继电气	43,600	870,692.00	0.20
169	603267	鸿远电子	8,600	869,976.00	0.20
170	600516	方大炭素	141,200	864,144.00	0.20
171	000623	吉林敖东	57,400	860,426.00	0.20

172	600170	上海建工	329,900	857,740.00	0.20
173	603160	汇顶科技	17,000	853,400.00	0.20
174	002444	巨星科技	44,600	846,508.00	0.20
175	603444	吉比特	2,700	844,668.00	0.20
176	600038	中直股份	18,200	844,662.00	0.20
177	600637	东方明珠	126,700	842,555.00	0.20
178	002531	天顺风能	55,600	841,228.00	0.20
179	601577	长沙银行	124,400	840,944.00	0.20
180	002372	伟星新材	39,380	840,369.20	0.20
181	300418	昆仑万维	58,300	840,103.00	0.20
182	300017	网宿科技	150,300	838,674.00	0.20
183	600642	申能股份	151,600	832,284.00	0.19
184	600739	辽宁成大	66,100	832,199.00	0.19
185	600166	福田汽车	295,900	831,479.00	0.19
186	601456	国联证券	73,900	831,375.00	0.19
187	603712	七一二	23,800	831,096.00	0.19
188	300373	扬杰科技	15,800	831,080.00	0.19
189	600699	均胜电子	59,100	830,355.00	0.19
190	002326	永太科技	37,900	827,357.00	0.19
191	002203	海亮股份	72,900	823,770.00	0.19
192	000970	中科三环	60,150	820,446.00	0.19
193	688002	睿创微纳	21,904	814,609.76	0.19
194	603127	昭衍新	13,940	814,235.40	0.19

		药			
195	000155	川能动力	45,600	813,504.00	0.19
196	002508	老板电器	29,300	813,368.00	0.19
197	603026	胜华新材	8,800	812,240.00	0.19
198	600673	东阳光	92,900	807,301.00	0.19
199	600380	健康元	71,308	805,067.32	0.19
200	689009	九号公司	26,402	804,996.98	0.19
201	000039	中集集团	113,910	801,926.40	0.19
202	600909	华安证券	174,370	800,358.30	0.19
203	600056	中国医药	46,260	797,059.80	0.19
204	600867	通化东宝	86,400	793,152.00	0.19
205	300676	华大基因	15,300	790,857.00	0.19
206	000739	普洛药业	36,500	786,210.00	0.18
207	000750	国海证券	235,950	785,713.50	0.18
208	002065	东华软件	138,800	785,608.00	0.18
209	600985	淮北矿业	61,300	784,640.00	0.18
210	600118	中国卫星	36,400	784,420.00	0.18
211	300244	迪安诊断	31,001	779,055.13	0.18
212	300058	蓝色光标	153,800	776,690.00	0.18
213	600008	首创环保	271,640	768,741.20	0.18
214	600369	西南证券	204,800	768,000.00	0.18
215	688009	中国通号	159,714	765,030.06	0.18
216	002152	广电运通	76,900	764,386.00	0.18

217	300474	景嘉微	13,950	761,251.50	0.18
218	002831	裕同科技	22,980	759,948.60	0.18
219	300558	贝达药业	15,400	758,758.00	0.18
220	600372	中航电子	47,400	756,978.00	0.18
221	600998	九州通	57,800	753,712.00	0.18
222	601880	辽港股份	465,000	753,300.00	0.18
223	000513	丽珠集团	23,164	752,366.72	0.18
224	600435	北方导航	64,600	749,360.00	0.18
225	000027	深圳能源	117,660	748,317.60	0.18
226	002936	郑州银行	317,859	746,968.65	0.17
227	300866	安克创新	12,600	746,802.00	0.17
228	000547	航天发展	79,400	745,566.00	0.17
229	000636	风华高科	50,000	741,500.00	0.17
230	002408	齐翔腾达	105,320	741,452.80	0.17
231	300070	碧水源	156,300	739,299.00	0.17
232	002131	利欧股份	416,592	737,367.84	0.17
233	300026	红日药业	129,500	735,560.00	0.17
234	002506	协鑫集成	252,400	734,484.00	0.17
235	002926	华西证券	97,500	734,175.00	0.17
236	603883	老百姓	18,047	730,362.09	0.17
237	002212	天融信	73,000	729,270.00	0.17
238	300383	光环新网	88,900	725,424.00	0.17
239	600378	昊华科技	16,900	725,179.00	0.17
240	300682	朗新科技	32,800	720,944.00	0.17

241	002183	怡亚通	112,000	720,160.00	0.17
242	603858	步长制药	34,200	718,542.00	0.17
243	600820	隧道股份	135,800	715,666.00	0.17
244	002572	索菲亚	39,400	715,504.00	0.17
245	600271	航天信息	68,600	714,126.00	0.17
246	002195	二三四五	353,101	709,733.01	0.17
247	600580	卧龙电驱	56,900	708,974.00	0.17
248	603893	瑞芯微	10,300	708,743.00	0.17
249	000887	中鼎股份	48,900	707,583.00	0.17
250	300296	利亚德	124,900	706,934.00	0.17
251	002250	联化科技	45,600	706,800.00	0.17
252	002500	山西证券	133,310	706,543.00	0.17
253	002368	太极股份	25,102	706,119.26	0.17
254	600863	内蒙华电	202,100	705,329.00	0.17
255	600390	五矿资本	138,700	704,596.00	0.16
256	600848	上海临港	59,000	703,280.00	0.16
257	603156	养元饮品	31,400	699,278.00	0.16
258	600021	上海电力	69,700	697,697.00	0.16
259	688779	长远锂科	47,700	695,943.00	0.16
260	002958	青农商行	240,500	695,045.00	0.16
261	688538	和辉光电	257,851	691,040.68	0.16
262	601958	金铂股份	59,800	690,690.00	0.16
263	300024	机器人	76,600	687,868.00	0.16
264	300001	特锐德	44,901	682,944.21	0.16
265	600755	厦门国贸	95,200	679,728.00	0.16

		贸			
266	002244	滨江集团	76,800	678,144.00	0.16
267	300009	安科生物	72,376	677,439.36	0.16
268	688256	寒武纪科技	12,372	675,016.32	0.16
269	688521	芯原微电子	15,292	673,918.44	0.16
270	600208	新潮中宝	265,200	673,608.00	0.16
271	002155	湖南黄金	51,900	672,105.00	0.16
272	600316	洪都航空	26,501	667,560.19	0.16
273	002511	中顺洁柔	48,579	667,475.46	0.16
274	600315	上海家化	20,900	665,665.00	0.16
275	601231	环旭电子	40,900	663,807.00	0.16
276	000060	中金岭南	161,900	663,790.00	0.16
277	603885	吉祥航空	41,000	663,380.00	0.16
278	000997	新大陆	50,900	662,209.00	0.16
279	600060	海信视像	48,500	656,690.00	0.15
280	000050	深天马 A	75,800	656,428.00	0.15
281	300776	帝尔激光	5,200	655,200.00	0.15
282	601992	金隅集团	257,600	654,304.00	0.15
283	601005	重庆钢铁	413,600	653,488.00	0.15
284	603927	中科软	22,020	652,012.20	0.15
285	300850	新强联	12,200	650,016.00	0.15
286	600511	国药股份	23,202	647,335.80	0.15
287	603218	日月股份	31,620	641,886.00	0.15
288	601717	郑煤机	56,800	633,888.00	0.15

289	300251	光线传媒	72,400	626,984.00	0.15
290	600528	中铁工业	82,100	626,423.00	0.15
291	600801	华新水泥	42,100	623,922.00	0.15
292	600201	生物股份	69,178	623,293.78	0.15
293	600566	济川药业	22,800	620,616.00	0.15
294	002939	长城证券	74,600	617,688.00	0.14
295	300168	万达信息	73,200	617,076.00	0.14
296	000021	深科技	57,700	616,813.00	0.14
297	600171	上海贝岭	35,300	615,279.00	0.14
298	600066	宇通客车	81,900	615,069.00	0.14
299	688185	康希诺生物	4,200	613,284.00	0.14
300	000825	太钢不锈	141,700	612,144.00	0.14
301	002373	千方科技	68,300	609,236.00	0.14
302	600906	财达证券	80,000	605,600.00	0.14
303	600598	北大荒	44,000	605,440.00	0.14
304	600839	四川长虹	228,500	603,240.00	0.14
305	600827	百联股份	49,600	601,152.00	0.14
306	600282	南钢股份	190,800	601,020.00	0.14
307	300677	英科医疗	28,540	600,196.20	0.14
308	600535	天士力	55,600	598,256.00	0.14
309	600970	中材国际	70,100	597,252.00	0.14
310	601866	中远海发	244,500	591,690.00	0.14
311	601665	齐鲁银行	141,500	590,055.00	0.14

312	601778	晶科科技	107,200	589,600.00	0.14
313	002128	电投能源	47,500	586,150.00	0.14
314	300861	美畅股份	11,900	585,004.00	0.14
315	600500	中化国际	88,500	584,985.00	0.14
316	601179	中国西电	126,600	583,626.00	0.14
317	002153	石基信息	38,860	582,511.40	0.14
318	002127	南极电商	121,000	582,010.00	0.14
319	603568	伟明环保	31,399	581,823.47	0.14
320	600498	烽火通信	44,100	579,474.00	0.14
321	000709	河钢股份	255,900	578,334.00	0.14
322	688188	上海柏楚电子科技	2,660	577,432.80	0.14
323	603000	人民网	34,200	576,954.00	0.14
324	000930	中粮科技	69,000	576,840.00	0.14
325	002595	豪迈科技	24,700	571,805.00	0.13
326	000012	南玻 A	84,865	569,444.15	0.13
327	300182	捷成股份	126,900	567,243.00	0.13
328	600398	海澜之家	106,700	565,510.00	0.13
329	300888	稳健医疗	7,900	564,850.00	0.13
330	002701	奥瑞金	111,000	560,550.00	0.13
331	002124	天邦食品	91,100	556,621.00	0.13
332	000987	越秀资本	92,925	556,620.75	0.13
333	002019	亿帆医药	45,400	556,150.00	0.13
334	002985	北摩高	12,310	555,181.00	0.13

		科			
335	600959	江苏有线	185,600	551,232.00	0.13
336	002396	星网锐捷	28,700	549,892.00	0.13
337	000581	威孚高科	30,900	547,857.00	0.13
338	600895	张江高科	47,900	543,186.00	0.13
339	603707	健友股份	29,959	540,460.36	0.13
340	000401	冀东水泥	65,600	539,888.00	0.13
341	000598	兴蓉环境	110,300	539,367.00	0.13
342	000778	新兴铸管	147,400	538,010.00	0.13
343	300115	长盈精密	52,020	537,366.60	0.13
344	300618	寒锐钴业	13,400	536,670.00	0.13
345	600582	天地科技	101,900	529,880.00	0.12
346	002670	国盛金控	71,498	529,800.18	0.12
347	600663	陆家嘴	54,300	528,882.00	0.12
348	002249	大洋电机	102,800	526,336.00	0.12
349	300482	万孚生物	16,490	525,536.30	0.12
350	600718	东软集团	52,800	525,360.00	0.12
351	688208	道通科技	16,623	524,455.65	0.12
352	600297	广汇汽车	249,700	524,370.00	0.12
353	002690	美亚光电	21,830	521,737.00	0.12
354	002266	浙富控股	133,000	520,030.00	0.12
355	600507	方大特钢	86,149	518,616.98	0.12
356	600329	达仁堂	17,800	517,980.00	0.12

357	603225	新凤鸣	47,220	513,753.60	0.12
358	600517	国网英大	106,000	513,040.00	0.12
359	688690	纳微科技	9,900	512,523.00	0.12
360	000883	湖北能源	121,700	511,140.00	0.12
361	002505	鹏都农牧	197,000	508,260.00	0.12
362	603866	桃李面包	32,919	506,952.60	0.12
363	300212	易华录	24,680	503,718.80	0.12
364	600409	三友化工	76,200	503,682.00	0.12
365	000656	金科股份	263,300	502,903.00	0.12
366	600259	广晟有色	12,500	502,500.00	0.12
367	601000	唐山港	183,330	502,324.20	0.12
368	600022	山东钢铁	338,900	501,572.00	0.12
369	000089	深圳机场	63,400	498,324.00	0.12
370	002002	鸿达兴业	153,800	498,312.00	0.12
371	600871	石化油服	251,300	497,574.00	0.12
372	601106	中国一重	169,800	497,514.00	0.12
373	600567	山鹰国际	200,200	496,496.00	0.12
374	000785	居然之家	121,000	494,890.00	0.12
375	600064	南京高科	74,696	493,740.56	0.12
376	300376	易事特	71,900	491,077.00	0.11
377	002429	兆驰股份	139,700	487,553.00	0.11
378	600216	浙江医药	41,700	487,473.00	0.11
379	002468	申通快递	47,100	486,543.00	0.11
380	600782	新钢股	117,900	482,211.00	0.11

		份			
381	688029	南微医学科技	5,820	477,996.60	0.11
382	002081	金螳螂	98,500	477,725.00	0.11
383	601333	广深铁路	209,400	475,338.00	0.11
384	601718	际华集团	163,200	474,912.00	0.11
385	600667	太极实业	91,200	470,592.00	0.11
386	601187	厦门银行	81,600	467,568.00	0.11
387	601118	海南橡胶	106,000	464,280.00	0.11
388	002010	传化智联	86,800	463,512.00	0.11
389	600062	华润双鹤	25,800	461,562.00	0.11
390	002191	劲嘉股份	63,700	460,551.00	0.11
391	600728	佳都科技	87,200	460,416.00	0.11
392	600737	中粮糖业	66,200	459,428.00	0.11
393	000540	中天金融	303,900	458,889.00	0.11
394	300463	迈克生物	26,500	458,450.00	0.11
395	600597	光明乳业	42,600	458,376.00	0.11
396	000537	广宇发展	34,500	456,435.00	0.11
397	600376	首开股份	79,800	454,062.00	0.11
398	600155	华创阳安	69,800	453,700.00	0.11
399	601156	东航物流	29,500	450,170.00	0.11
400	002221	东华能源	58,400	445,592.00	0.10
401	002745	木林森	54,800	444,428.00	0.10
402	600131	国网通信	29,700	444,312.00	0.10

403	601098	中南传媒	44,400	443,112.00	0.10
404	300072	海新能科	101,500	442,540.00	0.10
405	002416	爱施德	45,881	434,951.88	0.10
406	600967	内蒙一机	52,500	433,650.00	0.10
407	600126	杭钢股份	104,120	430,015.60	0.10
408	603379	三美股份	15,100	429,746.00	0.10
409	000156	华数传媒	57,100	427,679.00	0.10
410	601991	大唐发电	152,500	425,475.00	0.10
411	603228	景旺电子	21,001	425,060.24	0.10
412	002048	宁波华翔	30,100	418,390.00	0.10
413	600808	马钢股份	148,700	417,847.00	0.10
414	601568	北元集团	73,490	416,688.30	0.10
415	000937	冀中能源	65,400	415,944.00	0.10
416	002423	中粮资本	57,100	408,836.00	0.10
417	002281	光迅科技	25,905	407,226.60	0.10
418	600901	江苏租赁	73,500	402,780.00	0.09
419	001914	招商积余	26,100	401,418.00	0.09
420	688289	圣湘生物	18,259	400,785.05	0.09
421	300630	普利制药	16,175	398,875.50	0.09
422	003035	南网能源	70,300	398,601.00	0.09
423	600095	湘财股份	52,700	398,412.00	0.09
424	600373	中文传媒	41,600	398,112.00	0.09

425	000559	万向钱潮	81,400	396,418.00	0.09
426	000898	鞍钢股份	148,300	395,961.00	0.09
427	603056	德邦股份	19,001	395,790.83	0.09
428	301029	怡合达	6,000	394,440.00	0.09
429	002434	万里扬	48,800	392,840.00	0.09
430	000402	金融街	73,800	387,450.00	0.09
431	603317	天味食品	14,040	385,819.20	0.09
432	002867	周大生	27,000	378,810.00	0.09
433	600556	天下秀	56,100	378,114.00	0.09
434	601598	中国外运	97,800	375,552.00	0.09
435	601928	凤凰传媒	47,400	375,408.00	0.09
436	601608	中信重工	107,300	374,477.00	0.09
437	601611	中国核建	49,100	373,160.00	0.09
438	000563	陕国投 A	122,420	370,932.60	0.09
439	600707	彩虹股份	89,100	368,874.00	0.09
440	600195	中牧股份	31,549	366,599.38	0.09
441	300257	开山股份	24,401	366,015.00	0.09
442	000959	首钢股份	97,000	365,690.00	0.09
443	002948	青岛银行	108,530	364,660.80	0.09
444	001203	大中矿业	28,100	363,333.00	0.09
445	600968	海油发展	125,300	360,864.00	0.08
446	600167	联美控股	56,480	356,953.60	0.08
447	000967	盈峰环境	78,300	355,482.00	0.08
448	002110	三钢闽光	75,550	355,085.00	0.08

449	002705	新宝股份	20,400	339,660.00	0.08
450	603650	彤程新材	11,000	339,130.00	0.08
451	000415	渤海租赁	152,600	337,246.00	0.08
452	000990	诚志股份	37,500	330,000.00	0.08
453	688006	浙江杭可科技	7,400	323,898.00	0.08
454	300869	康泰医学	9,900	322,443.00	0.08
455	002925	盈趣科技	19,380	320,157.60	0.07
456	600307	酒钢宏兴	193,100	318,615.00	0.07
457	601828	美凯龙	66,900	313,761.00	0.07
458	002242	九阳股份	19,001	313,136.48	0.07
459	603638	艾迪精密	20,820	310,634.40	0.07
460	600339	中油工程	104,000	309,920.00	0.07
461	688819	天能电池集团股份	8,400	308,616.00	0.07
462	600764	中国海防	13,200	303,072.00	0.07
463	000031	大悦城	79,400	298,544.00	0.07
464	002653	海思科	13,400	298,150.00	0.07
465	002399	海普瑞	23,200	298,120.00	0.07
466	600623	华谊集团	46,600	294,512.00	0.07
467	002146	荣盛发展	134,800	292,516.00	0.07
468	600928	西安银行	82,200	289,344.00	0.07
469	688088	虹软科技	12,444	280,114.44	0.07
470	601969	海南矿业	37,600	278,616.00	0.07
471	600006	东风汽车	49,500	276,210.00	0.06

472	600648	外高桥	23,100	276,045.00	0.06
473	603719	良品铺子	7,400	272,838.00	0.06
474	600787	中储股份	54,300	269,871.00	0.06
475	002563	森马服饰	50,300	263,572.00	0.06
476	000961	中南建设	117,500	257,325.00	0.06
477	000869	张裕 A	8,500	257,040.00	0.06
478	600377	宁沪高速	30,600	251,532.00	0.06
479	000553	安道麦 A	27,100	245,255.00	0.06
480	601869	长飞光纤	7,500	244,725.00	0.06
481	601298	青岛港	43,400	243,474.00	0.06
482	600350	山东高速	41,800	237,842.00	0.06
483	000062	深圳华强	19,440	237,362.40	0.06
484	601139	深圳燃气	35,600	232,824.00	0.05
485	002945	华林证券	16,800	221,424.00	0.05
486	601228	广州港	65,500	206,325.00	0.05
487	600299	安迪苏	24,900	205,674.00	0.05
488	001872	招商港口	14,300	205,348.00	0.05
489	603868	飞科电器	3,000	201,990.00	0.05
490	603355	莱克电气	7,142	200,261.68	0.05
491	600956	新天绿能	19,033	183,478.12	0.04
492	601158	重庆水务	35,500	182,115.00	0.04
493	300741	华宝股份	7,600	178,828.00	0.04
494	603786	科博达	2,500	164,575.00	0.04
495	600927	永安期货	9,900	159,588.00	0.04
496	600917	重庆燃	19,502	155,235.92	0.04

		气			
497	600032	浙江新能	12,900	148,221.00	0.03
498	001227	兰州银行	39,200	147,784.00	0.03
499	688772	珠海冠宇电池	7,000	130,480.00	0.03
500	002901	大博医疗	3,600	122,508.00	0.03

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

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	301265	华新环保	806	9,188.40	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	002340	格林美	2,990,279.00	0.74
2	300012	华测检测	2,719,188.00	0.67
3	600096	云天化	2,659,576.00	0.66
4	002497	雅化集团	2,584,375.00	0.64
5	300769	德方纳米	2,579,162.00	0.64
6	002240	盛新锂能	2,434,590.00	0.60
7	600157	永泰能源	2,205,912.00	0.55
8	300390	天华超净	2,084,687.00	0.52
9	002407	多氟多	2,082,340.00	0.52
10	300073	当升科技	2,029,394.00	0.50
11	688180	君实生物	1,992,338.25	0.49
12	688122	西部超导	1,990,110.39	0.49
13	688063	派能科技	1,985,609.56	0.49
14	300003	乐普医疗	1,948,604.00	0.48
15	002756	永兴材料	1,849,562.80	0.46
16	601058	赛轮轮胎	1,825,899.00	0.45
17	601108	财通证券	1,757,961.40	0.44

18	605358	立昂微	1,757,502.52	0.43
19	688777	中控技术	1,756,128.84	0.43
20	002738	中矿资源	1,736,304.00	0.43

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	600256	广汇能源	3,232,359.00	0.80
2	600522	中天科技	2,985,254.00	0.74
3	000733	振华科技	2,909,360.00	0.72
4	601615	明阳智能	2,830,816.00	0.70
5	002180	纳思达	2,510,674.00	0.62
6	002340	格林美	2,490,275.02	0.62
7	600188	兖矿能源	2,461,698.00	0.61
8	600732	爱旭股份	2,193,655.00	0.54
9	300769	德方纳米	2,077,710.00	0.51
10	300751	迈为股份	2,063,593.60	0.51
11	600233	圆通速递	2,051,350.00	0.51
12	601117	中国化学	2,035,883.00	0.50
13	000723	美锦能源	1,986,917.00	0.49
14	002240	盛新锂能	1,889,579.00	0.47
15	000983	山西焦煤	1,840,274.00	0.46
16	688005	容百科技	1,817,701.50	0.45
17	605117	德业股份	1,721,094.00	0.43
18	600884	杉杉股份	1,663,699.44	0.41
19	601689	拓普集团	1,639,130.56	0.41
20	605358	立昂微	1,618,103.56	0.40

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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	253,263,603.61
卖出股票收入（成交）总额	153,752,319.30

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,667,091.42	0.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债 (可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	3,667,091.42	0.86

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019656	21 国债 08	21,000	2,136,777.04	0.50
2	019666	22 国债 01	15,000	1,530,314.38	0.36

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、中国银保监会及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查,或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	1,151,715.37
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,395,745.54
6	其他应收款	14,255.12
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,561,716.03

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: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

8.12.5.1 期末指数投资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	600157	永泰能源	581,400.00	0.14	转融通出借流通受限
2	300724	捷佳伟创	547,296.00	0.13	转融通出借流通受限
3	300003	乐普医疗	528,310.00	0.12	转融通出

					借流通受限
4	002422	科伦药业	524,217.00	0.12	转融通出借流通受限

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	301265	华新环保	9,188.40	0.00	新股流通受限

§ 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

份额级别	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	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
汇添富中证 500 指数 (LOF) A	17,136	15,009.11	10,010,000.00	3.89	247,186,188.48	96.11
汇添富中证 500 指数 (LOF) C	21,295	6,462.50	10,836,623.65	7.87	126,782,215.43	92.13
合计	38,431	10,273.35	20,846,623.65	5.28	373,968,403.91	94.72

9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证 500 指数 (LOF) A			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)

1	王增有	406,795.00	5.22
2	钟爱民	166,061.00	2.13
3	高明英	137,684.00	1.77
4	余建萍	127,722.00	1.64
5	韩立钰	119,314.00	1.53
6	赵鸿	106,331.00	1.37
7	王轶轮	104,512.00	1.34
8	李峰	101,125.00	1.30
9	陈靖	99,412.00	1.28
10	闫丽京	99,412.00	1.28
汇添富中证 500 指数 (LOF) C			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	玉志	950,674.00	24.30
2	黄晖	324,069.00	8.28
3	赵丽妹	200,018.00	5.11
4	于文华	150,175.00	3.84
5	欧阳东	150,000.00	3.83
6	王建伟	107,872.00	2.76
7	金林忠	100,000.00	2.56
8	顾奔驰	99,018.00	2.53
9	黄晓云	77,358.00	1.98
10	任小疆	64,416.00	1.65

注：本基金为 LOF 基金，上表持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	394,612.22	0.15
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	582.38	0.00
	合计	395,194.60	0.10

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数 (LOF) A	0
	汇添富中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证 500 指数（LOF）A	0
	汇添富中证 500 指数（LOF）C	0
	合计	0

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有 10,002,700.27 份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为 2017 年 08 月 10 日（合同生效日）起 3 年。截至本报告期末，最低持有期限届满，发起资金持有份额为 0.00 份。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证 500 指数（LOF）A	汇添富中证 500 指数（LOF）C
基金合同生效日 （2017 年 08 月 10 日） 基金份额总额	346,914,435.24	388,890,254.39
本报告期期初基金份额总额	202,719,670.47	105,119,773.46
本报告期基金总申购份额	151,426,985.41	314,499,896.88
减：本报告期基金总赎回份额	96,950,467.40	282,000,831.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	257,196,188.48	137,618,839.08

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2017 年 08 月 10 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币 50,000.00 元。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 08 月 04 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	对某单一资管计划投资者，未及时提供信息披露文件
管理人采取整改措施的情况	公司已完成整改并通过监管验收
其他	无

注：报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查、处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

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

交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
----	------	-----------	----

名称	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)
招商证券	2	400,108,476.62	100.00	287,960.91	100.00

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

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		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
招商证券	3,855,220.16	100.00	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协

助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定, 同一基金管理人托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 01 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 22 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第二季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 21 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 17 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年中期报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 31 日
9	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2022 年 09 月 21 日

10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第三季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 26 日
11	关于汇添富基金管理股份有限公司调整旗下部分基金申购起点金额、最低赎回份额、最低保留份额及单笔最低转换份额的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 12 日
12	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 12 日

§ 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者超过 20%的情况

注: 无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 募集的文件;
- 2、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 基金合同》;
- 3、《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 托管协议》;
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 5、报告期内汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金 (LOF) 在规定报刊上披露的各项公告;
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号

汇添富基金管理股份有限公司

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅, 或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅, 还可拨打基金管理人客户服务中心电话: 400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 03 月 31 日