

**华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数  
证券投资基金  
2023 年中期报告  
2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	178
7.1 期末基金资产组合情况.....	178
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	178
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	179
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	182
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	183
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	184
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	184
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	184
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	184
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	184
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	184
7.12 投资组合报告附注.....	185
§8 基金份额持有人信息.....	186
§9 开放式基金份额变动.....	187
§10 重大事件揭示.....	187
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	190
§12 备查文件目录.....	190

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证科创创业 50ETF
场内简称	科创创业 50ETF
基金主代码	159783
交易代码	159783
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 24 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,396,659,442.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 7 月 5 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括完全复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，衍生品投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证科创创业 50 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金资产投资于科创板与创业板，会面临科创板与创业板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板与创业板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66596688
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲 3 号院	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	泰大厦B座8层	
邮政编码	100033	100818
法定代表人	杨明辉	葛海蛟

### 2.5 信息披露方式

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

### 2.6 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-185,778,783.89
本期利润	-213,261,826.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0320
本期加权平均净值利润率	-5.25%
本期基金份额净值增长率	-5.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-3,150,682,372.28
期末可供分配基金份额利润	-0.4260
期末基金资产净值	4,245,977,069.72
期末基金份额净值	0.5740
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-42.60%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	------	-------	-------	-------	-----	-----

	增长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	-1.00%	1.28%	-1.21%	1.28%	0.21%	0.00%
过去三个月	-7.60%	1.16%	-8.16%	1.16%	0.56%	0.00%
过去六个月	-5.62%	1.08%	-6.14%	1.08%	0.52%	0.00%
过去一年	-17.40%	1.27%	-17.84%	1.27%	0.44%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-42.60%	1.55%	-40.97%	1.57%	-1.63%	-0.02%

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

华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2021 年 6 月 24 日至 2023 年 6 月 30 日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉、沈阳设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金

管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

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

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

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

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中，华夏大中华信用债券 (QDII) (A 类)排名第 1/24、华夏收益债券 (QDII) (A 类)排名第 3/24；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏 30 天滚动短债债券发起式(A 类)排名第 8/108；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎隆债券(A 类)排名前 6%(71/1228)、华夏鼎航债券(A 类)排名前 6%(76/1228)、华夏鼎英债券(A 类)排名前 7%(87/1228)；在

普通债券型基金(可投转债)(A 类)中, 华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名前 9%(32/376); 在普通债券型基金(二级)(A 类)中, 华夏恒融债券排名前 8%(30/368)。

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

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

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

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐猛	本基金的	2021-06-24	-	20 年	硕士。曾任财富证券助理研究

	基金经 理、投委 会成员			<p>员，原中关村证券研究员等。2006 年 2 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部基金经理助理、上证原材料交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2016 年 1 月 29 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 3 月 12 日至 2021 年 2 月 1 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 3 月 12 日至 2021 年 2 月 1 日期间）、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 4 月 8 日至 2021 年 7 月 19 日期间）、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 8 日至 2021 年 7 月 19 日期间）、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018 年 7 月 13 日至 2021 年 7 月 19 日期间）、华夏创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2018 年 8 月 14 日至 2021 年 7 月 19 日期间）、战略新兴成指交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019 年 6 月 5 日至 2021 年 7 月 19 日期间）、华夏中小企业 100 交易型开放式指数基金发起式联接基金基金经理（2018 年 9 月 10 日至 2021 年 9 月 10 日期间）等。</p>
--	--------------------	--	--	--

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 90 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证科创创业 50 指数，中证科创创业 50 指数从科创板和创业板中选取市值较大的 50 只新兴产业上市公司证券作为指数样本，以反映上述市场中代表性新兴产业上市公司证券的整体表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，全球主要经济体增长放缓，美欧通胀见顶回落，但仍处高位，主要经济体货币政策紧缩外溢效应突出，硅谷银行倒闭、瑞士信贷被收购等事件引发国际金融市场大幅震荡；西方继续对俄实施大规模制裁，地缘政治冲突升级并进一步影响全球经济秩序的风险犹存。国内方面，一季度经济开局良好，二季度延续恢复态势，在复杂严峻的外部环境下，上半年我国经济增速明显快于世界主要发达经济体，彰显出我国经济发展的强大韧性；经济增长由去年的以投资和出口拉动为主，转为今年的以消费和投资拉动为主，消费潜力逐步释放，为推动经济恢复向好发挥了重要作用，上半年最终消费支出增长对经济增长的贡献率达到 77.2%。

市场方面，A 股市场在全球主要市场中表现相对落后，在缺乏增量资金入场的背景下，A 股市场呈现存量博弈的特征，指数及行业表现较为分化，从宽基指数表现来看，科创 50、中证 1000、中

证 500 等中小盘指数表现较强，沪深 300、上证 50、创业板指等大盘指数表现较弱；传媒、通信及计算机为代表的 TMT 板块在 ChatGPT、数字经济等主题驱动下强势领涨，而与居民消费和投资强相关的商贸零售、美容护理、地产等板块跌幅居前。市场风格方面，价值风格优于成长风格，沪深 300、中证 500、中证 1000 的价值指数表现均优于对应的成长指数。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回、成份股调整和转融通证券出借等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，经深圳证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商为海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、东海证券股份有限公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.5740 元，本报告期份额净值增长率为-5.62%，同期业绩比较基准增长率-6.14%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.52%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球主要经济体增速预计将继续放缓，通胀水平亦将继续回落，但中枢仍会在相对中高位。中美经济与货币周期错位继续演进，中国经济短周期即将触底，预计稳增长政策延续发力，货币政策稳健宽松，信贷政策保持积极，助力经济企稳和市场主体信心恢复。

市场方面，由于热点主题启动受政策和事件催化，且行情延续需要业绩支撑，尽管下半年 AI 与中特估等上半年热点主题可能仍会反复表现，但应该不再会一枝独秀，下半年 A 股市场或将回归景气主线，主题投资或将收敛于绩优主线。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基

金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 中期报告财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,092,292.24	9,836,365.69
结算备付金		659,145.73	383,520.09
存出保证金		95,682.80	112,402.45
交易性金融资产	6.4.7.2	4,235,170,597.04	3,988,069,838.37
其中：股票投资		4,232,330,166.67	3,987,322,238.47
基金投资		-	-
债券投资		2,840,430.37	747,599.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		19,455,785.84	3,736,362.96
应收股利		301,395.88	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	79,509.63	207,285.68
资产总计		4,269,854,409.16	4,002,345,775.24
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		14,975,046.92	2,876,491.26
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,685,539.36	1,722,457.35
应付托管费		337,107.86	344,491.49
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14,962.29	27,125.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	6,864,683.01	3,264,040.23
负债合计		23,877,339.44	8,234,606.15
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	7,396,659,442.00	6,567,259,442.00

未分配利润	6.4.7.8	-3,150,682,372.28	-2,573,148,272.91
净资产合计		4,245,977,069.72	3,994,111,169.09
负债和净资产总计		4,269,854,409.16	4,002,345,775.24

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5740 元，基金份额总额 7,396,659,442.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-201,032,843.31	-1,070,268,164.61
1.利息收入		3,472,418.33	4,895,698.10
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,612.66	71,478.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		3,440,805.67	4,824,219.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-176,824,045.72	-699,281,510.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-199,935,465.26	-715,687,610.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,730,317.41	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	21,381,102.13	16,406,099.99
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-27,483,042.57	-376,323,898.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-198,173.35	441,546.73
<b>减：二、营业总支出</b>		12,228,983.15	14,950,871.87
1.管理人报酬		10,093,206.48	12,348,173.78
2.托管费		2,018,641.27	2,469,634.74
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		12,398.32	17,367.31
8.其他费用	6.4.7.18	104,737.08	115,696.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-213,261,826.46	-1,085,219,036.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-213,261,826.46	-1,085,219,036.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-213,261,826.46	-1,085,219,036.48

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	6,567,259,442.00	-	-2,573,148,272.91	3,994,111,169.09
二、本期期初净资产（基金净值）	6,567,259,442.00	-	-2,573,148,272.91	3,994,111,169.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	829,400,000.00	-	-577,534,099.37	251,865,900.63
（一）、综合收益总额	-	-	-213,261,826.46	-213,261,826.46
（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）	829,400,000.00	-	-364,272,272.91	465,127,727.09
其中：1.基金申购款	1,500,200,000.00	-	-613,344,926.27	886,855,073.73
2.基金赎回款	-670,800,000.00	-	249,072,653.36	-421,727,346.64
（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）	7,396,659,442.00	-	-3,150,682,372.28	4,245,977,069.72
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	6,736,259,442.00	-	-1,036,731,383.89	5,699,528,058.11
二、本期期初净资产（基金净值）	6,736,259,442.00	-	-1,036,731,383.89	5,699,528,058.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	101,400,000.00	-	-1,049,294,265.11	-947,894,265.11
（一）、综合收益总额	-	-	-1,085,219,036.48	-1,085,219,036.48
（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）	101,400,000.00	-	35,924,771.37	137,324,771.37
其中：1.基金申购款	2,831,400,000.00	-	-833,447,489.22	1,997,952,510.78
2.基金赎回款	-2,730,000,000.00	-	869,372,260.59	-1,860,627,739.41
（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）	6,837,659,442.00	-	-2,086,025,649.00	4,751,633,793.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]2012 号文《关于准予华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办

法》、《华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金于 2021 年 6 月 21 日共募集 3,000,004,137.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 60739337\_A103 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,000,059,442.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 55,305.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金标的指数为中证科创创业 50 指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含存托凭证、科创板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

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

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	14,092,292.24
等于：本金	14,090,763.00
加：应计利息	1,529.24
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	14,092,292.24

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,290,982,819.73	-	4,232,330,166.67	-1,058,652,653.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,239,000.00	706.67	2,840,430.37	600,723.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,239,000.00	706.67	2,840,430.37	600,723.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,293,221,819.73	706.67	4,235,170,597.04	-1,058,051,929.36

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	79,509.63
待摊费用	-
合计	79,509.63

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	358,298.68
其中：交易所市场	358,298.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
应退替代款	6,276,201.98
可退替代款	135,962.80
合计	6,864,683.01

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,567,259,442.00	6,567,259,442.00
本期申购	1,500,200,000.00	1,500,200,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-670,800,000.00	-670,800,000.00
本期末	7,396,659,442.00	7,396,659,442.00

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,239,085,487.40	-1,334,062,785.51	-2,573,148,272.91
本期利润	-185,778,783.89	-27,483,042.57	-213,261,826.46
本期基金份额交易产生的变动数	-173,971,283.91	-190,300,989.00	-364,272,272.91
其中：基金申购款	-308,023,640.25	-305,321,286.02	-613,344,926.27
基金赎回款	134,052,356.34	115,020,297.02	249,072,653.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,598,835,555.20	-1,551,846,817.08	-3,150,682,372.28

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,231.74
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	7,897.16
其他	483.76
合计	31,612.66

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-123,929,983.18
股票投资收益——赎回差价收入	-76,005,482.08
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-199,935,465.26

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	467,820,841.43
减：卖出股票成本总额	590,722,189.13
减：交易费用	1,028,635.48
买卖股票差价收入	-123,929,983.18

##### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	421,727,346.64
减：现金支付赎回款总额	126,811,596.64
减：赎回股票成本总额	370,921,232.08
减：交易费用	-
赎回差价收入	-76,005,482.08

##### 6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,155.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,727,161.54
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	1,730,317.41

## 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,369,455.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,639,000.00
减：应计利息总额	2,838.78
减：交易费用	454.83
买卖债券差价收入	1,727,161.54

## 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.13 衍生工具收益

## 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	21,381,102.13
其中：证券出借权益补偿收入	1,189,550.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	21,381,102.13

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-27,483,042.57
——股票投资	-27,986,461.27
——债券投资	503,418.70
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-27,483,042.57

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-198,173.35
合计	-198,173.35

## 6.4.7.17 信用减值损失

无。

## 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	10,517.53
存托服务费	-
其他	-
合计	104,737.08

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

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

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏科创创业 50ETF 发起式联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	467,965,466.23	42.85%	511,366,939.46	20.39%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	1,639,390.46	14.42%	-	-

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	201,835.50	42.84%	98,573.83	27.51%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	220,554.55	20.38%	220,174.45	16.04%

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,093,206.48	12,348,173.78

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

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,018,641.27	2,469,634.74

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

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	2023010300001272	欣旺达	2023-01-03	526,350.00	24,200.00	14	3.30	675.48	-	-
中信证券	2023010300034773	宁德时代	2023-01-03	818,244.00	2,100.00	14	1.80	572.77	-	-
中信证券	2023010300034829	晶盛机电	2023-01-03	191,970.00	3,000.00	14	1.80	134.38	-	-
中信证券	2023010300034835	泰格医药	2023-01-03	30,570.00	300.00	14	1.80	21.40	-	-
中信证券	2023010300037291	中科创达	2023-01-03	6,210,600.00	60,000.00	14	2.70	6,521.13	-	-
中信证券	2023010300039633	澜起科技	2023-01-03	6,259,000.00	100,000.00	14	1.80	4,381.30	-	-

中信 证券	202301030003 9641	澜 起 科 技	2023-01 -03	137,698.00	2,200.00	14	1.80	96.39	-	-
中信 证券	202301030003 9741	中 微 公 司	2023-01 -03	119,880.00	1,200.00	14	1.80	83.92	-	-
中信 证券	202301030003 9751	君 实 生 物	2023-01 -03	105,672.00	1,700.00	14	1.80	73.97	-	-
中信 证券	202301030003 9797	三 环 集 团	2023-01 -03	24,640.00	800.00	14	1.80	17.25	-	-
中信 证券	202301030003 9805	先 导 智 能	2023-01 -03	358,092.00	8,700.00	14	1.80	250.66	-	-
中信 证券	202301030003 9815	亿 联 网 络	2023-01 -03	72,456.00	1,200.00	14	1.80	50.72	-	-
中信 证券	202301030003 9947	欣 旺 达	2023-01 -03	1,435,500. 00	66,000.0 0	14	3.80	2,121.3 5	-	-
中信 证券	202301030003 9987	中 科 创 达	2023-01 -03	20,702.00	200.00	14	1.80	14.49	-	-
中信 证券	202301030003 9991	沃 森 生 物	2023-01 -03	39,980.00	1,000.00	14	1.80	27.99	-	-
中信 证券	202301030003 9993	欣 旺 达	2023-01 -03	128,325.00	5,900.00	14	1.80	89.83	-	-
中信 证券	202301030004 0025	大 全 能 源	2023-01 -03	1,764,120. 00	36,600.0 0	14	7.40	5,076.7 5	-	-

中信证券	202301030004 0295	迈瑞医疗	2023-01 -03	155,680.00	500.00	14	1.80	108.98	-	-
中信证券	202301030004 0297	容百科技	2023-01 -03	42,600.00	600.00	14	1.80	29.82	-	-
中信证券	202301030004 0299	亿纬锂能	2023-01 -03	489,832.00	5,600.00	14	1.80	342.88	-	-
中信证券	202301030004 0301	智飞生物	2023-01 -03	53,112.00	600.00	14	1.80	37.18	-	-
中信证券	202301030004 0303	汇川技术	2023-01 -03	924,132.00	13,200.0 0	14	1.80	646.89	-	-
中信证券	202301030004 0343	欣旺达	2023-01 -03	224,025.00	10,300.0 0	14	3.80	331.06	-	-
中信证券	202301030004 0391	中国通号	2023-01 -03	60,375.00	12,500.0 0	14	1.80	42.26	-	-
中信证券	202301030004 0395	时代电气	2023-01 -03	55,300.00	1,000.00	14	1.80	38.71	-	-
中信证券	202301030004 0399	华润微	2023-01 -03	69,303.00	1,300.00	14	1.80	48.51	-	-
中信证券	202301040002 0790	泰格医药	2023-01 -04	5,260,000. 00	50,000.0 0	28	2.70	11,046. 00	-	-
中信证券	202301040002 0846	欣旺达	2023-01 -04	215,064.00	10,300.0 0	14	3.80	317.82	-	-

中信证券	202301050001 5763	德方 纳米	2023-01 -05	1,038,726. 00	4,600.00	14	1.80	727.11	-	-
中信证券	202301050001 5789	锦浪 科技	2023-01 -05	1,165,032. 00	6,600.00	14	1.80	815.52	-	-
中信证券	202301050001 5857	中伟 股份	2023-01 -05	615,120.00	8,800.00	14	1.80	430.58	-	-
中信证券	202301050001 9575	欣旺 达	2023-01 -05	221,862.00	10,300.0 0	14	3.80	327.86	-	-
中信证券	202301050001 9577	欣旺 达	2023-01 -05	389,874.00	18,100.0 0	14	3.80	576.15	-	-
中信证券	202301050001 9579	欣旺 达	2023-01 -05	521,268.00	24,200.0 0	14	3.80	770.32	-	-
中信证券	202301100001 4519	欣旺 达	2023-01 -10	549,098.00	24,200.0 0	14	3.30	1,006.6 8	-	-
中信证券	202301100001 5707	卓胜 微	2023-01 -10	1,290,300. 00	10,200.0 0	14	3.10	2,222.1 8	-	-
中信证券	202301100001 5717	欣旺 达	2023-01 -10	372,116.00	16,400.0 0	14	3.30	682.21	-	-
中信证券	202301100001 7901	卓胜 微	2023-01 -10	506,000.00	4,000.00	14	3.10	871.44	-	-
中信证券	202301110002 2319	锦浪 科技	2023-01 -11	2,280,972. 00	13,100.0 0	14	4.10	4,935.7 7	-	-

中信证券	202301110002 2343	欣旺达	2023-01 -11	536,514.00	24,200.0 0	14	3.30	934.43	-	-
中信证券	202301120001 2835	欣旺达	2023-01 -12	573,685.00	25,900.0 0	14	3.30	946.58	-	-
中信证券	202301120001 2837	欣旺达	2023-01 -12	363,260.00	16,400.0 0	14	3.30	599.38	-	-
中信证券	202301120001 2853	迈瑞医疗	2023-01 -12	3,218,000. 00	10,000.0 0	14	2.80	4,505.2 0	-	-
中信证券	202301120001 4319	康龙化成	2023-01 -12	342,720.00	4,500.00	14	1.80	308.45	-	-
中信证券	202301120001 4329	圣邦股份	2023-01 -12	454,328.00	2,800.00	14	1.80	408.90	-	-
中信证券	202301120001 4331	迈瑞医疗	2023-01 -12	7,143,960. 00	22,200.0 0	14	1.80	6,429.5 6	-	-
中信证券	202301120001 4695	阳光电源	2023-01 -12	2,082,747. 00	17,300.0 0	14	1.80	1,874.4 7	-	-
中信证券	202301120001 4697	亿纬锂能	2023-01 -12	492,130.00	5,800.00	14	1.80	442.92	-	-
中信证券	202301120001 4699	沃森生物	2023-01 -12	68,814.00	1,800.00	14	1.80	61.93	-	-
中信证券	202301120001 4829	卓胜微	2023-01 -12	496,400.00	4,000.00	14	1.80	446.76	-	-

中信证券	202301120001 4833	先导智能	2023-01 -12	2,594,269. 00	59,900.0 0	14	1.80	2,334.8 4	-	-
中信证券	202301120001 4835	三环集团	2023-01 -12	585,895.00	18,500.0 0	14	1.80	527.31	-	-
中信证券	202301120001 4839	宁德时代	2023-01 -12	2,514,300. 00	5,800.00	14	1.80	2,262.8 7	-	-
中信证券	202301120001 4841	中科创达	2023-01 -12	522,300.00	5,000.00	14	1.80	470.07	-	-
中信证券	202301120001 4857	阳光电源	2023-01 -12	529,716.00	4,400.00	14	1.80	476.74	-	-
中信证券	202301120001 4859	汇川技术	2023-01 -12	1,756,577. 00	26,300.0 0	14	1.80	1,580.9 2	-	-
中信证券	202301120001 4861	智飞生物	2023-01 -12	3,122,680. 00	30,200.0 0	14	1.80	2,810.4 1	-	-
中信证券	202301130000 8032	迈瑞医疗	2023-01 -13	661,640.00	2,000.00	14	1.80	562.39	-	-
中信证券	202301170000 1184	先导智能	2023-01 -17	267,668.00	6,100.00	14	1.80	187.37	-	-
中信证券	202301170002 6685	澜起科技	2023-01 -17	6,214,000. 00	100,000. 00	14	1.80	4,349.8 0	-	-
中信证券	202301170002 7249	中科创达	2023-01 -17	6,331,800. 00	60,000.0 0	14	3.00	7,387.1 0	-	-

中信证券	202301170002 7331	大全能源	2023-01 -17	1,803,282.00	36,600.00	14	4.60	3,225.87	-	-
中信证券	202301170002 7377	欣旺达	2023-01 -17	544,500.00	24,200.00	14	3.10	656.43	-	-
中信证券	202301170002 9717	迈瑞医疗	2023-01 -17	169,665.00	500.00	14	1.80	118.77	-	-
中信证券	202301170002 9747	泰格医药	2023-01 -17	35,445.00	300.00	14	1.80	24.81	-	-
中信证券	202301170002 9779	中科创达	2023-01 -17	21,106.00	200.00	14	1.80	14.77	-	-
中信证券	202301170002 9839	智飞生物	2023-01 -17	63,120.00	600.00	14	1.80	44.18	-	-
中信证券	202301170002 9841	汇川技术	2023-01 -17	904,596.00	13,200.00	14	1.80	633.22	-	-
中信证券	202301170002 9909	中国通号	2023-01 -17	59,125.00	12,500.00	14	1.80	41.39	-	-
中信证券	202301170002 9911	亿联网络	2023-01 -17	73,392.00	1,200.00	14	1.80	51.37	-	-
中信证券	202301170003 0461	中微公司	2023-01 -17	127,584.00	1,200.00	14	1.80	89.31	-	-
中信证券	202301170003 0469	时代电气	2023-01 -17	56,400.00	1,000.00	14	1.80	39.48	-	-

中信证券	202301170003 0549	容百科技	2023-01 -17	44,562.00	600.00	14	1.80	31.19	-	-
中信证券	202301170003 0559	华润微	2023-01 -17	72,878.00	1,300.00	14	1.80	51.01	-	-
中信证券	202301170003 0593	宁德时代	2023-01 -17	935,781.00	2,100.00	14	1.80	655.05	-	-
中信证券	202301170003 1169	欣旺达	2023-01 -17	231,750.00	10,300.0 0	14	3.10	279.39	-	-
中信证券	202301170003 2867	亿纬锂能	2023-01 -17	469,224.00	5,600.00	14	1.80	328.46	-	-
中信证券	202301170003 2959	三环集团	2023-01 -17	26,784.00	800.00	14	1.80	18.75	-	-
中信证券	202301170003 2965	欣旺达	2023-01 -17	132,750.00	5,900.00	14	1.80	92.93	-	-
中信证券	202301170003 2971	先导智能	2023-01 -17	381,756.00	8,700.00	14	1.80	267.23	-	-
中信证券	202301170003 3265	沃森生物	2023-01 -17	40,640.00	1,000.00	14	1.80	28.45	-	-
中信证券	202301170003 3327	晶盛机电	2023-01 -17	201,000.00	3,000.00	14	1.80	140.70	-	-
中信证券	202301170003 3417	君实生物	2023-01 -17	106,369.00	1,700.00	14	1.80	74.46	-	-

中信证券	202301170003 3693	澜起科技	2023-01 -17	136,708.00	2,200.00	14	1.80	95.70	-	-
中信证券	202301180001 6875	欣旺达	2023-01 -18	232,162.00	10,300.0 0	14	3.10	279.88	-	-
中信证券	202301190000 1220	深信服	2023-01 -19	3,534,000. 00	22,800.0 0	14	3.30	4,535.3 0	-	-
中信证券	202301190001 4226	德方纳米	2023-01 -19	1,141,812. 00	4,600.00	14	1.80	799.27	-	-
中信证券	202301190001 4230	锦浪科技	2023-01 -19	1,133,220. 00	6,600.00	14	1.80	793.25	-	-
中信证券	202301190001 5560	欣旺达	2023-01 -19	232,986.00	10,300.0 0	14	3.10	280.88	-	-
中信证券	202301190001 5562	欣旺达	2023-01 -19	409,422.00	18,100.0 0	14	3.10	493.58	-	-
中信证券	202301190001 5564	欣旺达	2023-01 -19	547,404.00	24,200.0 0	14	3.10	659.93	-	-
中信证券	202301300007 3849	欣旺达	2023-01 -30	566,280.00	24,200.0 0	14	3.10	682.68	-	-
中信证券	202301300007 5173	欣旺达	2023-01 -30	383,760.00	16,400.0 0	14	3.10	462.64	-	-
中信证券	202301300007 5177	欣旺达	2023-01 -30	566,280.00	24,200.0 0	14	3.10	682.68	-	-

中信证券	202301300007 5209	锦浪科技	2023-01 -30	2,374,244. 00	13,100.0 0	14	4.30	3,970.2 6	-	-
中信证券	202301300007 5217	卓胜微	2023-01 -30	1,441,770. 00	10,200.0 0	14	2.20	1,233.5 1	-	-
中信证券	202301300007 5219	卓胜微	2023-01 -30	565,400.00	4,000.00	14	2.20	483.73	-	-
中信证券	202301300008 0181	欣旺达	2023-01 -30	606,060.00	25,900.0 0	14	3.40	801.35	-	-
中信证券	202301300008 1021	迈瑞医疗	2023-01 -30	678,720.00	2,000.00	14	1.80	475.10	-	-
中信证券	202301300008 2389	宁德时代	2023-01 -30	2,729,770. 00	5,800.00	14	1.80	1,910.8 4	-	-
中信证券	202301300008 2391	中科创达	2023-01 -30	556,850.00	5,000.00	14	1.80	389.80	-	-
中信证券	202301300008 2395	迈瑞医疗	2023-01 -30	7,533,792. 00	22,200.0 0	14	1.80	5,273.6 5	-	-
中信证券	202301300008 2423	圣邦股份	2023-01 -30	534,828.00	2,800.00	14	1.80	374.38	-	-
中信证券	202301300008 2425	先导智能	2023-01 -30	2,779,959. 00	59,900.0 0	14	1.80	1,945.9 7	-	-
中信证券	202301300008 2427	三环集团	2023-01 -30	637,695.00	18,500.0 0	14	1.80	446.39	-	-

中信 证券	202301300008 2433	阳光 电源	2023-01 -30	575,960.00	4,400.00	14	1.80	403.17	-	-
中信 证券	202301300008 2441	卓胜 微	2023-01 -30	565,400.00	4,000.00	14	1.80	395.78	-	-
中信 证券	202301300008 2447	康龙 化成	2023-01 -30	368,100.00	4,500.00	14	1.80	257.67	-	-
中信 证券	202301300008 2455	阳光 电源	2023-01 -30	2,264,570. 00	17,300.0 0	14	1.80	1,585.2 0	-	-
中信 证券	202301300008 2457	亿纬 锂能	2023-01 -30	508,486.00	5,800.00	14	1.80	355.94	-	-
中信 证券	202301300008 2459	汇川 技术	2023-01 -30	1,904,646. 00	26,300.0 0	14	1.80	1,333.2 5	-	-
中信 证券	202301300008 2461	智飞 生物	2023-01 -30	2,998,860. 00	30,200.0 0	14	1.80	2,099.2 0	-	-
中信 证券	202301300008 2463	沃森 生物	2023-01 -30	72,684.00	1,800.00	14	1.80	50.88	-	-
中信 证券	202301300010 0885	欣旺 达	2023-01 -30	383,760.00	16,400.0 0	14	3.40	507.42	-	-
中信 证券	202301310002 2593	欣旺 达	2023-01 -31	568,700.00	24,200.0 0	14	3.40	751.95	-	-
中信 证券	202301310002 2595	欣旺 达	2023-01 -31	242,050.00	10,300.0 0	14	3.40	320.04	-	-

中信证券	202301310002 2619	中科 创达	2023-01 -31	6,583,800. 00	60,000.0 0	14	3.60	9,217.3 2	-	-
中信证券	202301310002 3349	智 飞 生 物	2023-01 -31	58,704.00	600.00	14	1.80	41.09	-	-
中信证券	202301310002 3351	中 科 创 达	2023-01 -31	21,946.00	200.00	14	1.80	15.36	-	-
中信证券	202301310002 3367	君 实 生 物	2023-01 -31	97,597.00	1,700.00	14	1.80	68.32	-	-
中信证券	202301310002 3387	泰 格 医 药	2023-01 -31	34,890.00	300.00	14	1.80	24.42	-	-
中信证券	202301310002 3409	沃 森 生 物	2023-01 -31	39,970.00	1,000.00	14	1.80	27.98	-	-
中信证券	202301310002 3413	华 润 微	2023-01 -31	71,331.00	1,300.00	14	1.80	49.93	-	-
中信证券	202301310002 3415	宁 德 时 代	2023-01 -31	976,920.00	2,100.00	14	1.80	683.84	-	-
中信证券	202301310002 3433	欣 旺 达	2023-01 -31	138,650.00	5,900.00	14	1.80	97.06	-	-
中信证券	202301310002 3453	中 国 通 号	2023-01 -31	60,500.00	12,500.0 0	14	1.80	42.35	-	-
中信证券	202301310002 3497	亿 纬 锂 能	2023-01 -31	493,080.00	5,600.00	14	1.80	345.16	-	-

中信证券	202301310002 3501	汇川技术	2023-01 -31	939,576.00	13,200.0 0	14	1.80	657.70	-	-
中信证券	202301310002 6299	迈瑞医疗	2023-01 -31	166,320.00	500.00	14	1.80	116.42	-	-
中信证券	202301310002 6305	中微公司	2023-01 -31	125,868.00	1,200.00	14	1.80	88.11	-	-
中信证券	202301310002 6339	三环集团	2023-01 -31	26,664.00	800.00	14	1.80	18.66	-	-
中信证券	202301310002 6949	澜起科技	2023-01 -31	121,902.00	2,200.00	14	1.80	85.33	-	-
中信证券	202301310002 6991	澜起科技	2023-01 -31	5,541,000. 00	100,000. 00	14	1.80	3,878.7 0	-	-
中信证券	202301310002 7015	先导智能	2023-01 -31	401,331.00	8,700.00	14	1.80	280.93	-	-
中信证券	202301310002 7071	亿联网络	2023-01 -31	73,416.00	1,200.00	14	1.80	51.39	-	-
中信证券	202301310002 7307	晶盛机电	2023-01 -31	206,280.00	3,000.00	14	1.80	144.40	-	-
中信证券	202301310002 7333	容百科技	2023-01 -31	47,178.00	600.00	14	1.80	33.02	-	-
中信证券	202301310002 8103	时代电气	2023-01 -31	55,830.00	1,000.00	14	1.80	39.08	-	-

中信证券	202301310003 0743	大全能源	2023-01-31	1,792,302.00	36,600.00	14	3.10	2,160.72	-	-
中信证券	202302010000 1925	欣旺达	2023-02-01	128,790.00	5,400.00	14	3.50	175.30	-	-
中信证券	202302010001 5248	欣旺达	2023-02-01	245,655.00	10,300.00	14	3.40	324.81	-	-
中信证券	202302010001 9678	泰格医药	2023-02-01	5,903,500.00	50,000.00	28	2.70	12,397.35	-	-
中信证券	202302020000 1559	欣旺达	2023-02-02	127,278.00	5,400.00	14	3.50	173.24	-	-
中信证券	202302020001 2449	德方纳米	2023-02-02	1,234,962.00	4,600.00	14	1.80	864.47	-	-
中信证券	202302020001 4199	深信服	2023-02-02	3,317,628.00	22,800.00	14	3.30	4,257.62	-	-
中信证券	202302020001 4937	欣旺达	2023-02-02	242,771.00	10,300.00	14	3.40	321.00	-	-
中信证券	202302020001 4939	欣旺达	2023-02-02	426,617.00	18,100.00	14	3.40	564.08	-	-
中信证券	202302020001 4941	欣旺达	2023-02-02	570,394.00	24,200.00	14	3.40	754.19	-	-
中信证券	202302020001 5095	锦浪科技	2023-02-02	1,120,614.00	6,600.00	14	1.80	784.43	-	-

中信证券	202302080000 1454	欣旺达	2023-02-08	124,902.00	5,400.00	14	3.40	165.15	-	-
中信证券	202302090000 1406	欣旺达	2023-02-09	126,198.00	5,400.00	14	3.40	166.86	-	-
中信证券	202302130005 8210	宁德时代	2023-02-13	2,668,000.00	5,800.00	14	1.80	1,867.60	-	-
中信证券	202302130005 8212	中科创达	2023-02-13	503,300.00	5,000.00	14	1.80	352.31	-	-
中信证券	202302130005 8216	迈瑞医疗	2023-02-13	7,116,432.00	22,200.00	14	1.80	4,981.50	-	-
中信证券	202302130005 8218	圣邦股份	2023-02-13	487,900.00	2,800.00	14	1.80	341.53	-	-
中信证券	202302130005 8220	先导智能	2023-02-13	2,769,177.00	59,900.00	14	1.80	1,938.42	-	-
中信证券	202302130005 8222	三环集团	2023-02-13	602,730.00	18,500.00	14	1.80	421.91	-	-
中信证券	202302130005 8232	康龙化成	2023-02-13	309,060.00	4,500.00	14	1.80	216.34	-	-
中信证券	202302130005 8234	亿纬锂能	2023-02-13	488,012.00	5,800.00	14	1.80	341.61	-	-
中信证券	202302130005 8966	欣旺达	2023-02-13	565,070.00	24,200.00	14	1.70	373.57	-	-

中信证券	202302130005 9338	欣旺达	2023-02 -13	604,765.00	25,900.0 0	14	1.70	399.82	-	-
中信证券	202302130006 0484	欣旺达	2023-02 -13	382,940.00	16,400.0 0	14	1.70	253.17	-	-
中信证券	202302130006 0486	欣旺达	2023-02 -13	565,070.00	24,200.0 0	14	1.70	373.57	-	-
中信证券	202302130006 0490	卓胜微	2023-02 -13	1,342,626. 00	10,200.0 0	14	1.70	887.62	-	-
中信证券	202302130006 0638	欣旺达	2023-02 -13	382,940.00	16,400.0 0	14	1.70	253.17	-	-
中信证券	202302130006 1104	锦浪科技	2023-02 -13	2,193,988. 00	13,100.0 0	14	1.70	1,450.4 7	-	-
中信证券	202302130006 6100	迈瑞医疗	2023-02 -13	641,120.00	2,000.00	14	1.80	448.78	-	-
中信证券	202302130007 0398	卓胜微	2023-02 -13	526,520.00	4,000.00	14	3.20	655.22	-	-
中信证券	202302130007 1064	阳光电源	2023-02 -13	532,004.00	4,400.00	14	1.80	372.40	-	-
中信证券	202302130007 1066	卓胜微	2023-02 -13	526,520.00	4,000.00	14	1.80	368.56	-	-
中信证券	202302130007 3990	阳光电源	2023-02 -13	2,091,743. 00	17,300.0 0	14	1.80	1,464.2 2	-	-

中信证券	202302130007 3992	汇川技术	2023-02 -13	1,959,350.00	26,300.00	14	1.80	1,371.55	-	-
中信证券	202302130007 3994	智飞生物	2023-02 -13	2,842,726.00	30,200.00	14	1.80	1,989.91	-	-
中信证券	202302130007 3996	沃森生物	2023-02 -13	70,398.00	1,800.00	14	1.80	49.28	-	-
中信证券	202302140000 1628	欣旺达	2023-02 -14	125,010.00	5,400.00	14	4.00	194.46	-	-
中信证券	202302140002 1563	欣旺达	2023-02 -14	560,230.00	24,200.00	14	3.40	740.75	-	-
中信证券	202302140002 1737	欣旺达	2023-02 -14	238,445.00	10,300.00	14	3.40	315.28	-	-
中信证券	202302140002 1769	大全能源	2023-02 -14	1,745,820.00	36,600.00	14	3.60	2,444.15	-	-
中信证券	202302140002 3405	中科创达	2023-02 -14	6,054,000.00	60,000.00	14	3.50	8,240.17	-	-
中信证券	202302140002 4701	中微公司	2023-02 -14	131,172.00	1,200.00	14	1.80	91.82	-	-
中信证券	202302140002 4719	晶盛机电	2023-02 -14	202,650.00	3,000.00	14	1.80	141.86	-	-
中信证券	202302140002 4737	中国通号	2023-02 -14	62,375.00	12,500.00	14	1.80	43.66	-	-

中信证券	202302140002 4739	容百科技	2023-02 -14	45,996.00	600.00	14	1.80	32.20	-	-
中信证券	202302140002 4753	澜起科技	2023-02 -14	138,160.00	2,200.00	14	1.80	96.71	-	-
中信证券	202302140002 4759	时代电气	2023-02 -14	54,200.00	1,000.00	14	1.80	37.94	-	-
中信证券	202302140002 4791	先导智能	2023-02 -14	400,374.00	8,700.00	14	1.80	280.26	-	-
中信证券	202302140002 4811	亿联网络	2023-02 -14	77,040.00	1,200.00	14	1.80	53.93	-	-
中信证券	202302140002 9531	智飞生物	2023-02 -14	56,808.00	600.00	14	1.80	39.77	-	-
中信证券	202302140002 9635	中科创达	2023-02 -14	20,180.00	200.00	14	1.80	14.13	-	-
中信证券	202302150001 7520	欣旺达	2023-02 -15	125,928.00	5,400.00	14	3.40	166.50	-	-
中信证券	202302150001 8308	欣旺达	2023-02 -15	240,196.00	10,300.00	14	3.40	317.59	-	-
中信证券	202302160001 3545	德方纳米	2023-02 -16	1,064,900.00	4,600.00	14	1.80	745.43	-	-
中信证券	202302160001 3577	锦浪科技	2023-02 -16	1,070,058.00	6,600.00	14	1.80	749.04	-	-

中信证券	202302160001 5241	欣旺达	2023-02 -16	121,500.00	5,400.00	14	3.40	160.65	-	-
中信证券	202302160001 5361	深信服	2023-02 -16	3,316,260. 00	22,800.0 0	14	3.60	4,642.7 6	-	-
中信证券	202302160001 5399	欣旺达	2023-02 -16	231,750.00	10,300.0 0	14	3.40	306.43	-	-
中信证券	202302160001 5401	欣旺达	2023-02 -16	407,250.00	18,100.0 0	14	3.40	538.48	-	-
中信证券	202302160001 5403	欣旺达	2023-02 -16	544,500.00	24,200.0 0	14	3.40	719.95	-	-
中信证券	202302220000 4682	欣旺达	2023-02 -22	117,774.00	5,400.00	14	4.00	183.20	-	-
中信证券	202302230000 1178	康龙化成	2023-02 -23	347,655.00	5,500.00	14	2.30	310.96	-	-
中信证券	202302230000 1253	先导智能	2023-02 -23	1,333,500. 00	30,000.0 0	14	1.80	933.45	-	-
中信证券	202302230000 4853	欣旺达	2023-02 -23	117,666.00	5,400.00	14	4.00	183.04	-	-
中信证券	202302270005 6552	欣旺达	2023-02 -27	517,638.00	24,200.0 0	14	3.70	744.82	-	-
中信证券	202302270005 7578	阳光电源	2023-02 -27	2,076,173. 00	17,300.0 0	14	1.80	1,453.3 2	-	-

中信证券	202302270005 7580	汇川技术	2023-02 -27	1,903,857. 00	26,300.0 0	14	1.80	1,332.7 0	-	-
中信证券	202302270005 7582	沃森生物	2023-02 -27	68,328.00	1,800.00	14	1.80	47.83	-	-
中信证券	202302270005 8528	康龙化成	2023-02 -27	268,875.00	4,500.00	14	1.80	188.21	-	-
中信证券	202302270005 9550	欣旺达	2023-02 -27	350,796.00	16,400.0 0	14	3.70	504.76	-	-
中信证券	202302270005 9592	欣旺达	2023-02 -27	554,001.00	25,900.0 0	14	3.70	797.15	-	-
中信证券	202302270006 0982	卓胜微	2023-02 -27	469,800.00	4,000.00	14	1.80	328.86	-	-
中信证券	202302270006 1022	卓胜微	2023-02 -27	469,800.00	4,000.00	14	3.50	639.45	-	-
中信证券	202302270006 1024	卓胜微	2023-02 -27	1,197,990. 00	10,200.0 0	14	3.50	1,630.6 0	-	-
中信证券	202302270006 1122	圣邦股份	2023-02 -27	449,680.00	2,800.00	14	1.80	314.78	-	-
中信证券	202302270006 1124	三环集团	2023-02 -27	589,225.00	18,500.0 0	14	1.80	412.46	-	-
中信证券	202302270006 4398	智飞生物	2023-02 -27	2,682,666. 00	30,200.0 0	14	1.80	1,877.8 7	-	-

中信证券	202302270006 6242	宁德时代	2023-02 -27	2,326,380. 00	5,800.00	14	1.80	1,628.4 7	-	-
中信证券	202302270006 6244	中科创达	2023-02 -27	469,900.00	5,000.00	14	1.80	328.93	-	-
中信证券	202302270006 6246	迈瑞医疗	2023-02 -27	6,936,834. 00	22,200.0 0	14	1.80	4,855.7 8	-	-
中信证券	202302270006 7680	先导智能	2023-02 -27	2,594,269. 00	59,900.0 0	14	1.80	1,815.9 9	-	-
中信证券	202302270007 0246	欣旺达	2023-02 -27	350,796.00	16,400.0 0	14	3.70	504.76	-	-
中信证券	202302270007 0248	欣旺达	2023-02 -27	517,638.00	24,200.0 0	14	3.70	744.82	-	-
中信证券	202302270007 4150	亿纬锂能	2023-02 -27	419,456.00	5,800.00	14	1.80	293.62	-	-
中信证券	202302270007 5404	迈瑞医疗	2023-02 -27	624,940.00	2,000.00	14	1.80	437.46	-	-
中信证券	202302270007 7120	锦浪科技	2023-02 -27	2,080,280. 00	13,100.0 0	14	4.40	3,559.5 9	-	-
中信证券	202302280001 9532	智飞生物	2023-02 -28	53,796.00	600.00	14	1.80	37.66	-	-
中信证券	202302280001 9542	欣旺达	2023-02 -28	523,204.00	24,200.0 0	14	3.70	752.83	-	-

中信证券	202302280001 9544	欣旺达	2023-02 -28	222,686.00	10,300.0 0	14	3.70	320.42	-	-
中信证券	202302280001 9550	先导智能	2023-02 -28	378,450.00	8,700.00	14	1.80	264.92	-	-
中信证券	202302280001 9586	大全能源	2023-02 -28	1,754,238. 00	36,600.0 0	14	2.30	1,569.0 7	-	-
中信证券	202302280001 9596	澜起科技	2023-02 -28	127,094.00	2,200.00	14	1.80	88.97	-	-
中信证券	202302280002 1630	中科创达	2023-02 -28	19,120.00	200.00	14	1.80	13.38	-	-
中信证券	202302280002 1636	欣旺达	2023-02 -28	116,748.00	5,400.00	14	3.70	167.99	-	-
中信证券	202302280002 4344	晶盛机电	2023-02 -28	205,800.00	3,000.00	14	1.80	144.06	-	-
中信证券	202302280002 4404	中国通号	2023-02 -28	63,875.00	12,500.0 0	14	1.80	44.71	-	-
中信证券	202302280002 4418	容百科技	2023-02 -28	43,278.00	600.00	14	1.80	30.29	-	-
中信证券	202302280002 4442	中微公司	2023-02 -28	126,360.00	1,200.00	14	1.80	88.45	-	-
中信证券	202302280002 4494	亿联网络	2023-02 -28	79,980.00	1,200.00	14	1.80	55.99	-	-

中信证券	202302280002 7360	时代电气	2023-02-28	51,750.00	1,000.00	14	1.80	36.23	-	-
中信证券	202303010000 1478	欣旺达	2023-03-01	761,600.00	35,000.00	28	3.80	2,250.95	-	-
中信证券	202303010001 4963	泰格医药	2023-03-01	5,695,000.00	50,000.00	28	3.20	14,174.22	-	-
中信证券	202303010001 6665	欣旺达	2023-03-01	117,504.00	5,400.00	14	3.70	169.08	-	-
中信证券	202303010001 6669	欣旺达	2023-03-01	224,128.00	10,300.00	14	3.70	322.50	-	-
中信证券	202303020000 1409	中科创达	2023-03-02	2,137,000.00	20,000.00	14	1.80	1,495.90	-	-
中信证券	202303020001 4039	欣旺达	2023-03-02	393,313.00	18,100.00	14	3.70	565.93	-	-
中信证券	202303020001 4041	欣旺达	2023-03-02	525,866.00	24,200.00	14	3.70	756.66	-	-
中信证券	202303020001 4149	深信服	2023-03-02	3,256,980.00	22,800.00	14	3.10	3,926.47	-	-
中信证券	202303020001 4177	欣旺达	2023-03-02	223,819.00	10,300.00	14	3.70	322.05	-	-
中信证券	202303020001 4179	欣旺达	2023-03-02	117,342.00	5,400.00	14	3.70	168.84	-	-

中信证券	202303020001 5487	德方纳米	2023-03 -02	1,003,628. 00	4,600.00	14	1.80	702.54	-	-
中信证券	202303020001 5549	锦浪科技	2023-03 -02	1,005,510. 00	6,600.00	14	1.80	703.86	-	-
中信证券	202303080000 6824	欣旺达	2023-03 -08	116,748.00	5,400.00	14	3.90	177.07	-	-
中信证券	202303090000 1263	中科创达	2023-03 -09	669,500.00	6,500.00	14	3.40	885.23	-	-
中信证券	202303090000 5970	康龙化成	2023-03 -09	315,865.00	5,500.00	14	3.30	405.36	-	-
中信证券	202303090000 6820	先导智能	2023-03 -09	1,260,300. 00	30,000.0 0	14	1.80	882.21	-	-
中信证券	202303090000 6846	欣旺达	2023-03 -09	113,022.00	5,400.00	14	3.90	171.42	-	-
中信证券	202303130004 9672	三环集团	2023-03 -13	575,720.00	18,500.0 0	14	1.80	403.00	-	-
中信证券	202303130005 3956	康龙化成	2023-03 -13	247,905.00	4,500.00	14	1.80	173.53	-	-
中信证券	202303130005 3966	汇川技术	2023-03 -13	1,915,955. 00	26,300.0 0	14	1.80	1,341.1 7	-	-
中信证券	202303130005 4366	阳光电源	2023-03 -13	1,927,393. 00	17,300.0 0	14	1.80	1,349.1 8	-	-

中信 证券	202303130005 4368	沃森 生物	2023-03 -13	68,706.00	1,800.00	14	1.80	48.09	-	-
中信 证券	202303130005 4436	亿纬 锂能	2023-03 -13	390,224.00	5,800.00	14	1.80	273.16	-	-
中信 证券	202303130005 4500	先导 智能	2023-03 -13	2,446,316. 00	59,900.0 0	14	1.80	1,712.4 2	-	-
中信 证券	202303130005 5364	智飞 生物	2023-03 -13	2,654,580. 00	30,200.0 0	14	1.80	1,858.2 1	-	-
中信 证券	202303130005 6134	欣旺 达	2023-03 -13	334,068.00	16,400.0 0	14	5.90	766.50	-	-
中信 证券	202303130005 6236	欣旺 达	2023-03 -13	492,954.00	24,200.0 0	14	5.90	1,131.0 6	-	-
中信 证券	202303130005 6268	欣旺 达	2023-03 -13	492,954.00	24,200.0 0	14	5.90	1,131.0 6	-	-
中信 证券	202303130005 6764	卓胜 微	2023-03 -13	468,800.00	4,000.00	14	1.80	328.16	-	-
中信 证券	202303130005 6822	中科 创达	2023-03 -13	516,550.00	5,000.00	14	1.80	361.59	-	-
中信 证券	202303130005 6824	迈瑞 医疗	2023-03 -13	6,860,022. 00	22,200.0 0	14	1.80	4,802.0 2	-	-
中信 证券	202303130005 7014	圣邦 股份	2023-03 -13	419,160.00	2,800.00	14	1.80	293.41	-	-

中信证券	202303130005 7036	宁德时代	2023-03 -13	2,273,600. 00	5,800.00	14	1.80	1,591.5 2	-	-
中信证券	202303130005 7288	锦浪科技	2023-03 -13	1,990,545. 00	13,100.0 0	14	3.40	2,631.9 4	-	-
中信证券	202303130006 4882	迈瑞医疗	2023-03 -13	618,020.00	2,000.00	14	1.80	432.61	-	-
中信证券	202303130006 5426	欣旺达	2023-03 -13	334,068.00	16,400.0 0	14	5.90	766.50	-	-
中信证券	202303130006 5466	欣旺达	2023-03 -13	527,583.00	25,900.0 0	14	5.90	1,210.5 1	-	-
中信证券	202303130007 2384	卓胜微	2023-03 -13	468,800.00	4,000.00	14	3.50	638.09	-	-
中信证券	202303130007 2386	卓胜微	2023-03 -13	1,195,440. 00	10,200.0 0	14	3.50	1,627.1 3	-	-
中信证券	202303140002 2062	欣旺达	2023-03 -14	207,545.00	10,300.0 0	14	5.90	476.20	-	-
中信证券	202303140002 2064	欣旺达	2023-03 -14	108,810.00	5,400.00	14	5.90	249.66	-	-
中信证券	202303140002 2066	欣旺达	2023-03 -14	487,630.00	24,200.0 0	14	5.90	1,118.8 4	-	-
中信证券	202303140002 4010	亿联网络	2023-03 -14	80,676.00	1,200.00	14	1.80	56.47	-	-

中信证券	202303140002 4022	中国 通号	2023-03 -14	68,250.00	12,500.0 0	14	1.80	47.78	-	-
中信证券	202303140002 4024	中微 公司	2023-03 -14	151,416.00	1,200.00	14	1.80	105.99	-	-
中信证券	202303140002 4066	澜起 科技	2023-03 -14	123,178.00	2,200.00	14	1.80	86.22	-	-
中信证券	202303140002 8106	晶盛 机电	2023-03 -14	201,570.00	3,000.00	14	1.80	141.10	-	-
中信证券	202303140002 8142	时代 电气	2023-03 -14	53,530.00	1,000.00	14	1.80	37.47	-	-
中信证券	202303140002 8170	中科 创达	2023-03 -14	20,792.00	200.00	14	1.80	14.55	-	-
中信证券	202303140002 8180	智飞 生物	2023-03 -14	53,868.00	600.00	14	1.80	37.71	-	-
中信证券	202303140002 8188	先导 智能	2023-03 -14	356,265.00	8,700.00	14	1.80	249.39	-	-
中信证券	202303140002 8290	容百 科技	2023-03 -14	43,158.00	600.00	14	1.80	30.21	-	-
中信证券	202303150001 6569	欣旺 达	2023-03 -15	207,648.00	10,300.0 0	14	5.90	476.44	-	-
中信证券	202303150001 7677	欣旺 达	2023-03 -15	108,864.00	5,400.00	14	5.90	249.78	-	-

中信证券	202303160001 1252	中科 创达	2023-03 -16	2,067,000. 00	20,000.0 0	14	1.80	1,446.9 0	-	-
中信证券	202303160001 1258	欣旺 达	2023-03 -16	197,039.00	10,300.0 0	14	5.90	452.10	-	-
中信证券	202303160001 1260	欣旺 达	2023-03 -16	103,302.00	5,400.00	14	5.90	237.02	-	-
中信证券	202303160001 1262	欣旺 达	2023-03 -16	346,253.00	18,100.0 0	14	5.90	794.46	-	-
中信证券	202303160001 1264	欣旺 达	2023-03 -16	462,946.00	24,200.0 0	14	5.90	1,062.2 0	-	-
中信证券	202303160001 1272	锦浪 科技	2023-03 -16	932,844.00	6,600.00	14	1.80	652.99	-	-
中信证券	202303160001 1276	德方 纳米	2023-03 -16	930,948.00	4,600.00	14	1.80	651.66	-	-
中信证券	202303160001 1350	深信 服	2023-03 -16	3,192,000. 00	22,800.0 0	14	3.20	3,972.2 7	-	-
中信证券	202303210000 1736	亿联 网络	2023-03 -21	1,343,000. 00	17,000.0 0	28	3.20	3,342.5 8	-	-
中信证券	202303220000 8871	欣旺 达	2023-03 -22	106,758.00	5,400.00	14	5.10	226.86	-	-
中信证券	202303230000 1334	先导 智能	2023-03 -23	272,826.00	6,900.00	14	1.80	190.98	-	-

中信 证券	202303230000 1336	智 飞 生 物	2023-03 -23	86,350.00	1,000.00	14	1.80	60.45	-	-
中信 证券	202303230000 1337	晶 盛 机 电	2023-03 -23	187,050.00	3,000.00	14	1.80	130.94	-	-
中信 证券	202303230000 1338	中 科 创 达	2023-03 -23	115,200.00	1,000.00	14	1.80	80.64	-	-
中信 证券	202303230000 1342	亿 联 网 络	2023-03 -23	102,060.00	1,200.00	14	1.80	71.44	-	-
中信 证券	202303230000 1507	时 代 电 气	2023-03 -23	51,330.00	1,000.00	14	1.80	35.93	-	-
中信 证券	202303230000 1524	中 芯 国 际	2023-03 -23	502,272.00	9,600.00	14	1.80	351.59	-	-
中信 证券	202303230000 1528	中 微 公 司	2023-03 -23	160,644.00	1,200.00	14	1.80	112.45	-	-
中信 证券	202303230000 1534	澜 起 科 技	2023-03 -23	151,800.00	2,200.00	14	1.80	106.26	-	-
中信 证券	202303230000 1538	容 百 科 技	2023-03 -23	73,400.00	1,000.00	14	1.80	51.38	-	-
中信 证券	202303230000 1540	中 国 通 号	2023-03 -23	69,375.00	12,500.00	14	1.80	48.56	-	-
中信 证券	202303230000 5752	康 龙 化 成	2023-03 -23	320,760.00	5,500.00	14	3.30	411.64	-	-

中信证券	202303230000 5924	欣旺达	2023-03 -23	106,812.00	5,400.00	14	5.10	211.84	-	-
中信证券	202303230000 5926	中科创达	2023-03 -23	748,800.00	6,500.00	14	3.70	1,077.4 4	-	-
中信证券	202303230000 6310	先导智能	2023-03 -23	1,186,200. 00	30,000.0 0	14	1.80	830.34	-	-
中信证券	202303270005 1121	圣邦股份	2023-03 -27	414,316.00	2,800.00	14	1.80	290.02	-	-
中信证券	202303270005 1841	先导智能	2023-03 -27	2,376,233. 00	59,900.0 0	14	1.80	1,663.3 6	-	-
中信证券	202303270005 1945	宁德时代	2023-03 -27	2,299,700. 00	5,800.00	14	1.80	1,609.7 9	-	-
中信证券	202303270005 1947	中科创达	2023-03 -27	561,750.00	5,000.00	14	1.80	393.23	-	-
中信证券	202303270005 2929	锦浪科技	2023-03 -27	1,795,748. 00	13,100.0 0	14	3.40	2,374.3 8	-	-
中信证券	202303270005 4651	三环集团	2023-03 -27	541,125.00	18,500.0 0	14	1.80	378.79	-	-
中信证券	202303270005 7785	汇川技术	2023-03 -27	1,833,110. 00	26,300.0 0	14	1.80	1,283.1 8	-	-
中信证券	202303270005 7787	沃森生物	2023-03 -27	64,638.00	1,800.00	14	1.80	45.25	-	-

中信证券	202303270005 8043	康 龙 化 成	2023-03 -27	266,715.00	4,500.00	14	1.80	186.70	-	-
中信证券	202303270005 8049	阳 光 电 源	2023-03 -27	1,823,420. 00	17,300.0 0	14	1.80	1,276.3 9	-	-
中信证券	202303270005 8051	欣 旺 达	2023-03 -27	334,232.00	16,400.0 0	14	4.20	545.91	-	-
中信证券	202303270005 8091	欣 旺 达	2023-03 -27	493,196.00	24,200.0 0	14	4.20	805.55	-	-
中信证券	202303270005 8157	卓 胜 微	2023-03 -27	486,000.00	4,000.00	14	3.50	661.50	-	-
中信证券	202303270005 8545	智 飞 生 物	2023-03 -27	2,613,810. 00	30,200.0 0	14	1.80	1,829.6 7	-	-
中信证券	202303270005 8643	欣 旺 达	2023-03 -27	493,196.00	24,200.0 0	14	4.20	805.55	-	-
中信证券	202303270005 8695	欣 旺 达	2023-03 -27	527,842.00	25,900.0 0	14	4.20	862.14	-	-
中信证券	202303270005 9157	欣 旺 达	2023-03 -27	334,232.00	16,400.0 0	14	4.20	545.91	-	-
中信证券	202303270006 4827	卓 胜 微	2023-03 -27	486,000.00	4,000.00	14	1.80	340.20	-	-
中信证券	202303270006 4839	迈 瑞 医 疗	2023-03 -27	6,782,100. 00	22,200.0 0	14	1.80	4,747.4 7	-	-

中信证券	202303270006 5623	亿纬锂能	2023-03 -27	396,604.00	5,800.00	14	1.80	277.62	-	-
中信证券	202303280000 2267	锦浪科技	2023-03 -28	1,946,180. 00	14,600.0 0	14	3.40	2,573.2 8	-	-
中信证券	202303280002 1049	欣旺达	2023-03 -28	207,442.00	10,300.0 0	14	4.20	338.82	-	-
中信证券	202303280002 1051	欣旺达	2023-03 -28	487,388.00	24,200.0 0	14	4.20	796.07	-	-
中信证券	202303280002 3483	欣旺达	2023-03 -28	108,756.00	5,400.00	14	4.20	177.63	-	-
中信证券	202303290001 6998	欣旺达	2023-03 -29	703,500.00	35,000.0 0	28	4.10	2,243.3 8	-	-
中信证券	202303290001 7374	泰格医药	2023-03 -29	5,133,000. 00	50,000.0 0	28	3.10	12,376. 23	-	-
中信证券	202303290001 8004	欣旺达	2023-03 -29	108,540.00	5,400.00	14	4.20	177.28	-	-
中信证券	202303300001 2599	中科创达	2023-03 -30	2,155,600. 00	20,000.0 0	14	1.80	1,508.9 2	-	-
中信证券	202303300001 2739	锦浪科技	2023-03 -30	885,390.00	6,600.00	14	1.80	619.77	-	-
中信证券	202303300001 2741	德方纳米	2023-03 -30	887,340.00	4,600.00	14	1.80	621.14	-	-

中信证券	202303300001 4169	欣旺达	2023-03 -30	363,448.00	18,100.0 0	14	4.20	593.63	-	-
中信证券	202303300001 7185	深信服	2023-03 -30	3,286,164. 00	22,800.0 0	14	3.10	3,961.6 5	-	-
中信证券	202304060001 2500	先导智能	2023-04 -06	1,159,800. 00	30,000.0 0	14	1.80	811.86	-	-
中信证券	202304060001 3962	亿联网络	2023-04 -06	84,624.00	1,200.00	14	1.80	59.24	-	-
中信证券	202304060001 5208	欣旺达	2023-04 -06	106,974.00	5,400.00	14	3.30	137.28	-	-
中信证券	202304060001 6024	康龙化成	2023-04 -06	275,715.00	5,500.00	14	1.40	150.11	-	-
中信证券	202304060001 6426	中科创达	2023-04 -06	116,400.00	1,000.00	14	1.80	81.48	-	-
中信证券	202304060001 6428	先导智能	2023-04 -06	266,754.00	6,900.00	14	1.80	186.73	-	-
中信证券	202304060001 6430	智飞生物	2023-04 -06	81,960.00	1,000.00	14	1.80	57.37	-	-
中信证券	202304060001 6436	晶盛机电	2023-04 -06	207,900.00	3,000.00	14	1.80	145.53	-	-
中信证券	202304060001 6440	中芯国际	2023-04 -06	567,072.00	9,600.00	14	1.80	396.95	-	-

中信证券	202304060001 6446	时代电气	2023-04-06	50,450.00	1,000.00	14	1.80	35.32	-	-
中信证券	202304060001 6452	澜起科技	2023-04-06	165,506.00	2,200.00	14	1.80	115.85	-	-
中信证券	202304060001 6454	中国通号	2023-04-06	70,000.00	12,500.00	14	1.80	49.00	-	-
中信证券	202304060001 6464	中微公司	2023-04-06	207,360.00	1,200.00	14	1.80	145.15	-	-
中信证券	202304100004 9221	迈瑞医疗	2023-04-10	6,924,180.00	22,200.00	14	1.80	4,846.93	-	-
中信证券	202304100004 9291	卓胜微	2023-04-10	525,840.00	4,000.00	14	3.00	613.48	-	-
中信证券	202304100004 9361	康龙化成	2023-04-10	235,035.00	4,500.00	14	1.80	164.52	-	-
中信证券	202304100005 0573	锦浪科技	2023-04-10	1,696,974.00	13,100.00	14	3.40	2,243.78	-	-
中信证券	202304100005 6833	亿纬锂能	2023-04-10	407,044.00	5,800.00	14	1.80	284.93	-	-
中信证券	202304100005 9643	卓胜微	2023-04-10	525,840.00	4,000.00	14	1.80	368.09	-	-
中信证券	202304100005 9649	宁德时代	2023-04-10	2,331,658.00	5,800.00	14	1.80	1,632.16	-	-

中信证券	202304100005 9651	中科 创达	2023-04 -10	562,000.00	5,000.00	14	1.80	393.40	-	-
中信证券	202304100005 9691	智 飞 生 物	2023-04 -10	2,494,520. 00	30,200.0 0	14	1.80	1,746.1 6	-	-
中信证券	202304100005 9757	三 环 集 团	2023-04 -10	613,090.00	18,500.0 0	14	1.80	429.16	-	-
中信证券	202304100005 9827	阳 光 电 源	2023-04 -10	1,755,085. 00	17,300.0 0	14	1.80	1,228.5 6	-	-
中信证券	202304100005 9829	沃 森 生 物	2023-04 -10	64,260.00	1,800.00	14	1.80	44.98	-	-
中信证券	202304100006 2519	圣 邦 股 份	2023-04 -10	452,620.00	2,800.00	14	1.80	316.83	-	-
中信证券	202304100006 2667	先 导 智 能	2023-04 -10	2,360,659. 00	59,900.0 0	14	1.80	1,652.4 6	-	-
中信证券	202304100006 6945	欣 旺 达	2023-04 -10	329,312.00	16,400.0 0	14	3.30	422.62	-	-
中信证券	202304100006 7041	汇 川 技 术	2023-04 -10	1,817,330. 00	26,300.0 0	14	1.80	1,272.1 3	-	-
中信证券	202304110001 8430	锦 浪 科 技	2023-04 -11	1,883,400. 00	14,600.0 0	14	3.40	2,490.2 7	-	-
中信证券	202304110002 0130	欣 旺 达	2023-04 -11	107,406.00	5,400.00	14	2.80	116.95	-	-

中信证券	202304110002 0136	欣旺达	2023-04 -11	481,338.00	24,200.0 0	14	2.80	524.12	-	-
中信证券	202304120001 1167	中控技术	2023-04 -12	4,995,000. 00	50,000.0 0	14	15.8 0	30,691. 50	-	-
中信证券	202304120002 9252	欣旺达	2023-04 -12	106,002.00	5,400.00	14	2.80	115.42	-	-
中信证券	202304130001 3415	锦浪科技	2023-04 -13	825,660.00	6,600.00	14	1.80	577.96	-	-
中信证券	202304130001 3865	德方纳米	2023-04 -13	935,502.00	4,600.00	14	1.80	654.85	-	-
中信证券	202304130001 3899	深信服	2023-04 -13	3,196,560. 00	22,800.0 0	14	3.00	3,729.3 2	-	-
中信证券	202304180001 1321	亿联网络	2023-04 -18	1,057,570. 00	17,000.0 0	28	3.30	2,714.4 3	-	-
中信证券	202304200000 3073	海光信息	2023-04 -20	5,838,000. 00	60,000.0 0	14	2.60	5,902.8 7	-	-
中信证券	202304200000 5569	先导智能	2023-04 -20	257,991.00	6,900.00	14	1.80	180.59	-	-
中信证券	202304200000 5577	亿联网络	2023-04 -20	74,352.00	1,200.00	14	1.80	52.05	-	-
中信证券	202304200000 5585	澜起科技	2023-04 -20	168,212.00	2,200.00	14	1.80	117.75	-	-

中信证券	202304200000 5587	中国通号	2023-04 -20	80,375.00	12,500.0 0	14	1.80	56.26	-	-
中信证券	202304200000 5591	中微公司	2023-04 -20	231,612.00	1,200.00	14	1.80	162.13	-	-
中信证券	202304200000 5627	中芯国际	2023-04 -20	638,208.00	9,600.00	14	1.80	446.75	-	-
中信证券	202304200000 5705	晶盛机电	2023-04 -20	205,200.00	3,000.00	14	1.80	143.64	-	-
中信证券	202304200000 5723	中科创达	2023-04 -20	97,100.00	1,000.00	14	1.80	67.97	-	-
中信证券	202304200000 5823	智飞生物	2023-04 -20	78,800.00	1,000.00	14	1.80	55.16	-	-
中信证券	202304200000 5851	时代电气	2023-04 -20	48,380.00	1,000.00	14	1.80	33.87	-	-
中信证券	202304200001 1921	欣旺达	2023-04 -20	101,196.00	5,400.00	14	2.90	114.13	-	-
中信证券	202304240002 8237	锦浪科技	2023-04 -24	1,539,905. 00	13,100.0 0	14	3.60	2,155.8 7	-	-
中信证券	202304240003 0771	三环集团	2023-04 -24	555,000.00	18,500.0 0	14	1.80	388.50	-	-
中信证券	202304240003 2917	卓胜微	2023-04 -24	424,240.00	4,000.00	14	1.80	296.97	-	-

中信证券	202304240003 5887	智飞生物	2023-04 -24	2,537,706.00	30,200.00	14	1.80	1,776.39	-	-
中信证券	202304240003 6449	康龙化成	2023-04 -24	222,300.00	4,500.00	14	1.80	155.61	-	-
中信证券	202304240004 3509	阳光电源	2023-04 -24	1,788,820.00	17,300.00	14	1.80	1,252.17	-	-
中信证券	202304240004 4735	汇川技术	2023-04 -24	1,606,667.00	26,300.00	14	1.80	1,124.67	-	-
中信证券	202304240004 8847	迈瑞医疗	2023-04 -24	6,693,300.00	22,200.00	14	1.80	4,685.31	-	-
中信证券	202304240005 1707	沃森生物	2023-04 -24	59,382.00	1,800.00	14	1.80	41.57	-	-
中信证券	202304240005 7025	圣邦股份	2023-04 -24	357,980.00	2,800.00	14	1.80	250.59	-	-
中信证券	202304240005 8083	中科创达	2023-04 -24	440,050.00	5,000.00	14	1.80	308.04	-	-
中信证券	202304240006 4547	亿纬锂能	2023-04 -24	359,716.00	5,800.00	14	1.80	251.80	-	-
中信证券	202304240006 5467	先导智能	2023-04 -24	2,151,608.00	59,900.00	14	1.80	1,506.13	-	-
中信证券	202304240006 7151	卓胜微	2023-04 -24	424,240.00	4,000.00	14	3.10	511.44	-	-

中信证券	202304240006 7155	宁德时代	2023-04 -24	2,301,904. 00	5,800.00	14	1.80	1,611.3 3	-	-
中信证券	202304250006 3003	锦浪科技	2023-04 -25	1,625,564. 00	14,600.0 0	14	3.60	2,275.7 9	-	-
中信证券	202304250006 5921	欣旺达	2023-04 -25	416,966.00	24,200.0 0	14	2.30	372.95	-	-
中信证券	202304250006 5947	欣旺达	2023-04 -25	93,042.00	5,400.00	14	2.30	83.22	-	-
中信证券	202304260000 8662	欣旺达	2023-04 -26	625,450.00	35,000.0 0	28	2.50	1,216.1 5	-	-
中信证券	202304260002 8932	泰格医药	2023-04 -26	4,637,000. 00	50,000.0 0	28	2.10	7,573.7 7	-	-
中信证券	202304260002 8940	中控技术	2023-04 -26	4,625,000. 00	50,000.0 0	14	5.90	10,611. 81	-	-
中信证券	202304260003 0156	欣旺达	2023-04 -26	96,498.00	5,400.00	14	2.30	86.31	-	-
中信证券	202304270000 9870	德方纳米	2023-04 -27	788,900.00	4,600.00	14	1.80	552.23	-	-
中信证券	202304270001 5708	锦浪科技	2023-04 -27	789,492.00	6,600.00	14	1.80	552.64	-	-
中信证券	202304270002 0350	深信服	2023-04 -27	2,712,972. 00	22,800.0 0	14	3.30	3,481.6 5	-	-

中信证券	202305040001 5635	欣旺达	2023-05 -04	90,666.00	5,400.00	14	2.60	91.67	-	-
中信证券	202305040001 8143	中芯国际	2023-05 -04	564,096.00	9,600.00	14	1.80	394.87	-	-
中信证券	202305040001 8147	澜起科技	2023-05 -04	130,570.00	2,200.00	14	1.80	91.40	-	-
中信证券	202305040002 2761	晶盛机电	2023-05 -04	202,230.00	3,000.00	14	1.80	141.56	-	-
中信证券	202305040002 9205	先导智能	2023-05 -04	260,061.00	6,900.00	14	1.80	182.04	-	-
中信证券	202305040002 9219	智飞生物	2023-05 -04	79,390.00	1,000.00	14	1.80	55.57	-	-
中信证券	202305040002 9263	时代电气	2023-05 -04	47,980.00	1,000.00	14	1.80	33.59	-	-
中信证券	202305040002 9321	中国通号	2023-05 -04	78,000.00	12,500.00	14	1.80	54.60	-	-
中信证券	202305040004 1899	中科创达	2023-05 -04	81,130.00	1,000.00	14	1.80	56.79	-	-
中信证券	202305040004 1953	中微公司	2023-05 -04	202,428.00	1,200.00	14	1.80	141.70	-	-
中信证券	202305040004 6049	亿联网络	2023-05 -04	74,916.00	1,200.00	14	1.80	52.44	-	-

中信证券	202305080000 6225	迈瑞医疗	2023-05 -08	6,685,308. 00	22,200.0 0	14	1.80	4,679.7 2	-	-
中信证券	202305080000 6769	亿纬锂能	2023-05 -08	370,794.00	5,800.00	14	1.80	259.56	-	-
中信证券	202305080000 7819	汇川技术	2023-05 -08	1,534,079. 00	26,300.0 0	14	1.80	1,073.8 6	-	-
中信证券	202305080000 8431	沃森生物	2023-05 -08	55,476.00	1,800.00	14	1.80	38.83	-	-
中信证券	202305080001 0105	卓胜微	2023-05 -08	396,720.00	4,000.00	14	3.20	493.70	-	-
中信证券	202305080001 4577	中科创达	2023-05 -08	422,850.00	5,000.00	14	1.80	296.00	-	-
中信证券	202305080001 5053	锦浪科技	2023-05 -08	1,456,458. 00	13,100.0 0	14	3.70	2,095.6 8	-	-
中信证券	202305080001 8295	康龙化成	2023-05 -08	216,315.00	4,500.00	14	1.80	151.42	-	-
中信证券	202305080002 5727	圣邦股份	2023-05 -08	345,660.00	2,800.00	14	1.80	241.96	-	-
中信证券	202305080002 9967	阳光电源	2023-05 -08	1,864,940. 00	17,300.0 0	14	1.80	1,305.4 6	-	-
中信证券	202305080003 0569	智飞生物	2023-05 -08	2,331,440. 00	30,200.0 0	14	1.80	1,632.0 1	-	-

中信证券	202305080003 7239	卓胜微	2023-05 -08	396,720.00	4,000.00	14	1.80	277.70	-	-
中信证券	202305080006 2989	宁德时代	2023-05 -08	1,338,698. 00	5,800.00	14	1.80	937.09	-	-
中信证券	202305080006 3339	先导智能	2023-05 -08	2,237,265. 00	59,900.0 0	14	1.80	1,566.0 9	-	-
中信证券	202305090001 2679	欣旺达	2023-05 -09	391,072.00	24,200.0 0	14	2.60	395.42	-	-
中信证券	202305090001 4045	锦浪科技	2023-05 -09	1,593,006. 00	14,600.0 0	14	3.70	2,292.1 6	-	-
中信证券	202305090001 6183	欣旺达	2023-05 -09	87,264.00	5,400.00	14	2.60	88.23	-	-
中信证券	202305100001 2864	欣旺达	2023-05 -10	88,128.00	5,400.00	14	2.60	89.11	-	-
中信证券	202305100002 2840	中控技术	2023-05 -10	4,949,000. 00	50,000.0 0	14	4.80	9,238.1 3	-	-
中信证券	202305110001 1183	锦浪科技	2023-05 -11	722,832.00	6,600.00	14	1.80	505.98	-	-
中信证券	202305110001 1195	德方纳米	2023-05 -11	788,164.00	4,600.00	14	1.80	551.71	-	-
中信证券	202305180000 4216	先导智能	2023-05 -18	250,608.00	6,900.00	14	3.40	331.36	-	-

中信证券	2023051800020328	中微公司	2023-05-18	196,800.00	1,200.00	14	1.80	137.76	-	-
中信证券	2023051800020422	澜起科技	2023-05-18	127,600.00	2,200.00	14	1.80	89.32	-	-
中信证券	2023051800025924	欣旺达	2023-05-18	88,344.00	5,400.00	14	3.30	113.37	-	-
中信证券	2023051800027366	中科创达	2023-05-18	91,300.00	1,000.00	14	1.80	63.91	-	-
中信证券	2023051800027490	晶盛机电	2023-05-18	216,390.00	3,000.00	14	1.80	151.47	-	-
中信证券	2023051800029228	亿联网络	2023-05-18	65,832.00	1,200.00	14	1.80	46.08	-	-
中信证券	2023051800030702	中国通号	2023-05-18	72,125.00	12,500.00	14	1.80	50.49	-	-
中信证券	2023051800030766	中芯国际	2023-05-18	528,960.00	9,600.00	14	1.80	370.27	-	-
中信证券	2023051800032844	时代电气	2023-05-18	47,130.00	1,000.00	14	1.80	32.99	-	-
中信证券	2023051800032888	智飞生物	2023-05-18	73,600.00	1,000.00	14	1.80	51.52	-	-
中信证券	2023052200024494	锦浪科技	2023-05-22	1,396,067.00	13,100.00	14	3.50	1,900.20	-	-

中信证券	202305230000 9490	欣旺达	2023-05 -23	88,560.00	5,400.00	14	3.10	106.76	-	-
中信证券	202305230002 3396	锦浪科技	2023-05 -23	1,540,592. 00	14,600.0 0	14	3.50	2,096.9 2	-	-
中信证券	202305230002 5528	欣旺达	2023-05 -23	396,880.00	24,200.0 0	14	3.10	478.46	-	-
中信证券	202305240001 1186	欣旺达	2023-05 -24	571,550.00	35,000.0 0	14	3.10	689.04	-	-
中信证券	202305240001 3848	欣旺达	2023-05 -24	88,182.00	5,400.00	14	3.10	106.31	-	-
中信证券	202305240002 2358	中控技术	2023-05 -24	4,993,000. 00	50,000.0 0	14	3.60	6,990.2 0	-	-
中信证券	202305240002 4928	泰格医药	2023-05 -24	4,400,000. 00	50,000.0 0	14	3.10	5,304.4 4	-	-
中信证券	202305250000 7386	锦浪科技	2023-05 -25	724,812.00	6,600.00	14	1.80	507.37	-	-
中信证券	202305250000 7388	德方纳米	2023-05 -25	804,770.00	4,600.00	14	1.80	563.34	-	-
中信证券	202305310000 0449	金山办公	2023-05 -31	17,280,000 .00	40,000.0 0	14	3.90	26,208. 00	-	-
中信证券	202306010000 5133	澜起科技	2023-06 -01	3,105,000. 00	50,000.0 0	14	4.10	4,950.7 5	-	-

中信证券	2023060100026823	中科 创达	2023-06-01	99,620.00	1,000.00	7	1.80	34.87	-	-
中信证券	2023060100031204	澜起科技	2023-06-01	136,620.00	2,200.00	7	1.80	47.82	-	-
中信证券	2023060100031603	智飞生物	2023-06-01	71,030.00	1,000.00	7	1.80	24.86	-	-
中信证券	2023060100032244	亿联网络	2023-06-01	64,956.00	1,200.00	7	1.80	22.73	-	-
中信证券	2023060100032821	先导智能	2023-06-01	231,150.00	6,900.00	7	3.50	157.31	-	-
中信证券	2023060100034062	时代电气	2023-06-01	44,350.00	1,000.00	7	1.80	15.52	-	-
中信证券	2023060100034892	晶盛机电	2023-06-01	203,550.00	3,000.00	7	1.80	71.24	-	-
中信证券	2023060100035151	欣旺达	2023-06-01	85,968.00	5,400.00	7	3.20	53.49	-	-
中信证券	2023060100036256	中国通号	2023-06-01	73,000.00	12,500.00	7	1.80	25.55	-	-
中信证券	2023060100036580	中芯国际	2023-06-01	522,432.00	9,600.00	7	1.80	182.85	-	-
中信证券	2023060100037728	中微公司	2023-06-01	205,512.00	1,200.00	7	1.80	71.93	-	-

中信证券	202306050002 4056	锦浪科技	2023-06 -05	1,290,481. 00	13,100.0 0	14	3.30	1,656.1 2	-	-
中信证券	202306060000 5689	凯赛生物	2023-06 -06	72,111.00	1,300.00	14	2.20	88.14	-	-
中信证券	202306060001 6863	锦浪科技	2023-06 -06	1,426,128. 00	14,600.0 0	14	3.30	1,830.2 0	-	-
中信证券	202306060001 8762	欣旺达	2023-06 -06	386,958.00	24,200.0 0	14	3.20	481.55	-	-
中信证券	202306060002 0293	欣旺达	2023-06 -06	86,346.00	5,400.00	14	3.20	107.45	-	-
中信证券	202306070001 6998	欣旺达	2023-06 -07	547,750.00	35,000.0 0	14	3.20	681.64	-	-
中信证券	202306070002 2460	中控技术	2023-06 -07	5,075,000. 00	50,000.0 0	14	3.60	7,105.0 0	-	-
中信证券	202306070002 4175	欣旺达	2023-06 -07	84,510.00	5,400.00	14	3.20	105.17	-	-
中信证券	202306080002 1839	智飞生物	2023-06 -08	66,660.00	1,000.00	7	1.80	23.33	-	-
中信证券	202306080002 2091	晶盛机电	2023-06 -08	195,000.00	3,000.00	7	1.80	68.25	-	-
中信证券	202306080002 4663	中国通号	2023-06 -08	73,750.00	12,500.0 0	7	1.80	25.81	-	-

中信证券	202306080002 4693	欣旺达	2023-06 -08	83,322.00	5,400.00	7	3.10	50.22	-	-
中信证券	202306080002 4924	先导智能	2023-06 -08	212,796.00	6,900.00	7	3.40	140.68	-	-
中信证券	202306080002 5061	澜起科技	2023-06 -08	125,642.00	2,200.00	7	1.80	43.97	-	-
中信证券	202306080002 5707	亿联网络	2023-06 -08	42,900.00	1,200.00	7	1.80	15.02	-	-
中信证券	202306080002 5984	中芯国际	2023-06 -08	514,176.00	9,600.00	7	1.80	179.96	-	-
中信证券	202306080002 6134	中微公司	2023-06 -08	182,532.00	1,200.00	7	1.80	63.89	-	-
中信证券	202306080002 6194	中科创达	2023-06 -08	95,320.00	1,000.00	7	1.80	33.36	-	-
中信证券	202306080002 7196	时代电气	2023-06 -08	42,150.00	1,000.00	7	1.80	14.75	-	-
中信证券	202306140005 2024	金山办公	2023-06 -14	18,848,400.00	40,000.00	14	3.90	28,586.74	-	-
中信证券	202306150001 2599	德方纳米	2023-06 -15	4,040,800.00	40,000.00	14	2.60	4,085.70	-	-
中信证券	202306150002 8583	智飞生物	2023-06 -15	41,022.00	600.00	7	1.80	22.56	-	-

中信证券	202306150003 4147	澜起科技	2023-06 -15	116,831.00	1,900.00	7	1.80	64.26	-	-
中信证券	202306150003 5888	欣旺达	2023-06 -15	87,264.00	5,400.00	14	2.90	98.41	-	-
中信证券	202306150003 7649	晶盛机电	2023-06 -15	203,550.00	3,000.00	7	1.80	111.95	-	-
中信证券	202306150003 8466	中科创达	2023-06 -15	20,770.00	200.00	7	1.80	11.42	-	-
中信证券	202306150003 8699	先导智能	2023-06 -15	125,689.00	3,700.00	7	3.30	126.74	-	-
中信证券	202306200002 2277	锦浪科技	2023-06 -20	1,991,175. 00	19,100.0 0	14	3.40	1,880.5 6	1,991,175. 00	1,880.5 6
中信证券	202306200002 2312	派能科技	2023-06 -20	205,000.00	1,000.00	14	3.60	1,157.0 0	205,000.00	1,157.0 0
中信证券	202306200002 2363	派能科技	2023-06 -20	2,050,000. 00	10,000.0 0	14	3.60	2,050.0 0	2,050,000. 00	2,050.0 0
中信证券	202306200003 3164	锦浪科技	2023-06 -20	1,522,050. 00	14,600.0 0	14	3.40	5,437.4 9	1,995,490. 00	5,437.4 9
中信证券	202306200003 3642	欣旺达	2023-06 -20	389,620.00	24,200.0 0	14	2.90	313.86	389,620.00	313.86
中信证券	202306200003 5123	欣旺达	2023-06 -20	86,940.00	5,400.00	14	2.90	70.04	86,940.00	70.04

中信证券	202306210000 0488	锦浪科技	2023-06 -21	2,038,000. 00	20,000.0 0	14	3.40	1,732.3 0	2,038,000. 00	1,732.3 0
中信证券	202306210001 2777	欣旺达	2023-06 -21	85,320.00	5,400.00	14	2.90	61.86	85,320.00	61.86
中信证券	202306210001 4825	欣旺达	2023-06 -21	553,000.00	35,000.0 0	14	2.90	400.92	553,000.00	400.92
中信证券	202306210001 7083	中控技术	2023-06 -21	4,626,500. 00	50,000.0 0	14	3.30	41,316. 86	8,790,350. 00	41,316. 86
中信证券	202306260004 0881	智飞生物	2023-06 -26	26,538.00	600.00	14	1.80	5.31	26,538.00	5.31
中信证券	202306260004 1403	澜起科技	2023-06 -26	106,400.00	1,900.00	14	1.80	21.28	106,400.00	21.28
中信证券	202306260004 1935	凯赛生物	2023-06 -26	83,070.00	1,300.00	14	2.70	24.92	83,070.00	24.92
中信证券	202306260004 2156	晶盛机电	2023-06 -26	201,240.00	3,000.00	14	1.80	40.25	201,240.00	40.25
中信证券	202306260004 5509	中科创达	2023-06 -26	20,540.00	200.00	14	1.80	4.11	20,540.00	4.11
中信证券	202306260004 6287	先导智能	2023-06 -26	128,427.00	3,700.00	14	3.20	2,032.5 6	128,427.00	2,032.5 6
中信证券	202306270000 9026	派能科技	2023-06 -27	196,810.00	1,000.00	14	3.60	59.04	196,810.00	59.04

中信证券	202306270000 9116	派能科技	2023-06 -27	1,968,100. 00	10,000.0 0	14	3.60	590.43	1,968,100. 00	590.43
中信证券	202306270000 9131	传音控股	2023-06 -27	18,862,360 .00	131,500. 00	14	3.40	5,344.3 4	18,862,360 .00	5,344.3 4
中信证券	202306270000 9143	容百科技	2023-06 -27	1,227,600. 00	24,000.0 0	14	3.30	337.59	1,227,600. 00	337.59
中信证券	202306280001 0084	中控技术	2023-06 -28	399,936.00	6,400.00	14	3.30	73.32	399,936.00	73.32
中信证券	202306280004 4932	金山办公	2023-06 -28	19,320,000 .00	40,000.0 0	14	3.60	3,864.0 0	19,320,000 .00	3,864.0 0
中信证券	202306290004 4379	欣旺达	2023-06 -29	86,184.00	5,400.00	14	3.10	7.42	86,184.00	7.42
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:股)	出借期限(单位:天)	费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	202201040000 0923	欣旺达	2022-01 -04	2,847,600. 00	70,000.0 0	14	2.70	2,989.9 8	-	-
中信证券	202201040002 1359	乐普医疗	2022-01 -04	70,860.00	3,000.00	14	3.20	88.18	-	-
中	202201040002	和	2022-01	31,300.00	10,000.0	14	1.30	15.82	-	-

信 证 券	1361	辉 光 电	-04		0					
中 信 证 券	202201040002 1363	深 信 服	2022-01 -04	1,886,000. 00	10,000.0 0	14	2.70	1,980.3 0	-	-
中 信 证 券	202201040002 1365	泰 格 医 药	2022-01 -04	237,080.00	2,000.00	14	2.50	230.49	-	-
中 信 证 券	202201060000 0410	迈 瑞 医 疗	2022-01 -06	3,684,200. 00	10,900.0 0	14	1.80	2,578.9 4	-	-
中 信 证 券	202201060000 0412	三 环 集 团	2022-01 -06	2,256,714. 00	52,900.0 0	14	1.80	1,579.7 0	-	-
中 信 证 券	202201060000 0419	泰 格 医 药	2022-01 -06	3,688,560. 00	32,700.0 0	14	1.80	2,581.9 9	-	-
中 信 证 券	202201060000 9973	蓝 思 科 技	2022-01 -06	849,680.00	38,000.0 0	14	2.60	859.12	-	-
中 信 证 券	202201060000 9975	亿 纬 锂 能	2022-01 -06	401,280.00	3,800.00	14	1.80	280.90	-	-
中 信 证 券	202201060000 9977	蓝 思 科 技	2022-01 -06	114,036.00	5,100.00	14	1.80	79.83	-	-
中 信 证 券	202201060000 9979	康 泰 生 物	2022-01 -06	126,280.00	1,400.00	14	1.80	88.40	-	-
中 信 证 券	202201060000 9981	智 飞 生 物	2022-01 -06	290,750.00	2,500.00	14	1.80	203.53	-	-
中	202201060000	亿	2022-01	82,000.00	1,000.00	14	1.80	57.40	-	-

信 证 券	9983	联 网 络	-06							
中 信 证 券	202201060000 9985	乐 普 医 疗	2022-01 -06	100,147.00	4,300.00	14	1.80	70.10	-	-
中 信 证 券	202201060000 9987	金 山 办 公	2022-01 -06	243,000.00	1,000.00	14	1.80	170.10	-	-
中 信 证 券	202201060000 9991	同 花 顺	2022-01 -06	135,070.00	1,000.00	14	1.80	94.55	-	-
中 信 证 券	202201060000 9993	卓 胜 微	2022-01 -06	313,000.00	1,000.00	14	1.80	219.10	-	-
中 信 证 券	202201060000 9995	中 微 公 司	2022-01 -06	157,352.00	1,300.00	14	1.80	110.15	-	-
中 信 证 券	202201060000 9997	澜 起 科 技	2022-01 -06	169,334.00	2,200.00	14	1.80	118.53	-	-
中 信 证 券	202201060000 9999	贝 达 药 业	2022-01 -06	78,910.00	1,000.00	14	1.80	55.24	-	-
中 信 证 券	202201060001 0001	迈 瑞 医 疗	2022-01 -06	676,000.00	2,000.00	14	1.80	473.20	-	-
中 信 证 券	202201060001 0003	传 音 控 股	2022-01 -06	183,720.00	1,200.00	14	1.80	128.60	-	-
中 信 证 券	202201060001 0005	中 国 通 号	2022-01 -06	62,750.00	12,500.0 0	14	1.80	43.93	-	-
中	202201060001	康	2022-01	129,800.00	1,000.00	14	1.80	90.86	-	-

信 证 券	0007	龙 化 成	-06								
中 信 证 券	202201060001 0009	沃 森 生 物	2022-01 -06	308,016.00	5,400.00	14	1.80	215.61	-	-	
中 信 证 券	202201060001 0011	三 环 集 团	2022-01 -06	157,842.00	3,700.00	14	1.80	110.49	-	-	
中 信 证 券	202201060001 0013	泰 格 医 药	2022-01 -06	203,040.00	1,800.00	14	1.80	142.13	-	-	
中 信 证 券	202201060001 0019	中 芯 国 际	2022-01 -06	290,400.00	5,500.00	14	1.80	203.28	-	-	
中 信 证 券	202201060001 1465	中 科 创 达	2022-01 -06	131,480.00	1,000.00	14	1.80	92.04	-	-	
中 信 证 券	202201060001 1467	汇 川 技 术	2022-01 -06	350,489.00	5,300.00	14	1.80	245.34	-	-	
中 信 证 券	202201060001 1469	阳 光 电 源	2022-01 -06	442,340.00	3,400.00	14	1.80	309.64	-	-	
中 信 证 券	202201060001 1471	华 润 微	2022-01 -06	79,716.00	1,300.00	14	1.80	55.80	-	-	
中 信 证 券	202201060001 1473	深 信 服	2022-01 -06	172,190.00	1,000.00	14	1.80	120.53	-	-	
中 信 证 券	202201060001 1475	欧 普 康 视	2022-01 -06	89,913.00	1,700.00	14	1.80	62.94	-	-	
中	202201060001	华	2022-01	88,900.00	1,000.00	14	1.80	62.23	-	-	

信 证 券	1477	大 基 因	-06							
中 信 证 券	202201060001 1479	先 导 智 能	2022-01 -06	216,576.00	3,200.00	14	1.80	151.60	-	-
中 信 证 券	202201060001 1481	君 实 生 物	2022-01 -06	56,680.00	1,000.00	14	1.80	39.68	-	-
中 信 证 券	202201060001 1909	汇 川 技 术	2022-01 -06	615,009.00	9,300.00	14	1.90	454.42	-	-
中 信 证 券	202201060001 1913	亿 纬 锂 能	2022-01 -06	728,640.00	6,900.00	14	1.90	538.38	-	-
中 信 证 券	202201060001 1915	宁 德 时 代	2022-01 -06	1,137,087. 00	2,100.00	14	1.90	840.18	-	-
中 信 证 券	202201060001 1917	先 导 智 能	2022-01 -06	385,776.00	5,700.00	14	1.90	285.05	-	-
中 信 证 券	202201100001 1435	迈 瑞 医 疗	2022-01 -10	2,252,436. 00	6,900.00	14	1.90	1,664.3 0	-	-
中 信 证 券	202201100001 1437	阳 光 电 源	2022-01 -10	11,590,950 .00	93,100.0 0	14	1.90	8,564.4 2	-	-
中 信 证 券	202201100001 2723	中 伟 股 份	2022-01 -10	1,343,100. 00	10,000.0 0	14	2.90	1,514.7 2	-	-
中 信 证 券	202201100001 2785	亿 纬 锂 能	2022-01 -10	11,801,060 .00	113,800. 00	14	1.90	8,719.6 7	-	-
中	202201110001	华	2022-01	3,200,760.	34,000.0	14	3.10	3,858.6	-	-

信 证 券	1887	大 基 因	-11	00	0			9		
中 信 证 券	202201130000 1150	欣 旺 达	2022-01 -13	863,190.00	23,000.0 0	14	2.90	973.49	-	-
中 信 证 券	202201130000 1160	亿 纬 锂 能	2022-01 -13	537,700.00	5,000.00	14	2.90	606.41	-	-
中 信 证 券	202201130000 9630	中 伟 股 份	2022-01 -13	1,367,500. 00	10,000.0 0	14	1.80	957.25	-	-
中 信 证 券	202201140002 0790	中 微 公 司	2022-01 -14	5,865,000. 00	50,000.0 0	14	2.50	5,702.0 8	-	-
中 信 证 券	202201140002 1466	和 辉 光 电	2022-01 -14	30,800.00	10,000.0 0	14	1.80	21.56	-	-
中 信 证 券	202201140002 1474	宁 德 时 代	2022-01 -14	1,732,200. 00	3,000.00	14	1.80	1,212.5 4	-	-
中 信 证 券	202201140002 1476	中 微 公 司	2022-01 -14	175,950.00	1,500.00	14	1.80	123.17	-	-
中 信 证 券	202201140002 1478	中 国 通 号	2022-01 -14	80,339.00	16,100.0 0	14	1.80	56.24	-	-
中 信 证 券	202201140002 1480	卓 胜 微	2022-01 -14	298,020.00	1,000.00	14	1.80	208.61	-	-
中 信 证 券	202201140002 1482	中 科 创 达	2022-01 -14	194,857.00	1,300.00	14	1.80	136.40	-	-
中	202201140002	康	2022-01	159,720.00	1,200.00	14	1.80	111.80	-	-

信 证 券	1484	龙 化 成	-14							
中 信 证 券	202201140002 1486	圣 邦 股 份	2022-01 -14	286,700.00	1,000.00	14	1.80	200.69	-	-
中 信 证 券	202201140002 1488	汇 川 技 术	2022-01 -14	435,200.00	6,800.00	14	1.80	304.64	-	-
中 信 证 券	202201140002 1490	蓝 思 科 技	2022-01 -14	133,452.00	6,600.00	14	1.80	93.42	-	-
中 信 证 券	202201140002 1492	同 花 顺	2022-01 -14	123,950.00	1,000.00	14	1.80	86.77	-	-
中 信 证 券	202201140002 1494	三 环 集 团	2022-01 -14	200,304.00	4,800.00	14	1.80	140.21	-	-
中 信 证 券	202201140002 1496	亿 联 网 络	2022-01 -14	95,496.00	1,200.00	14	1.80	66.85	-	-
中 信 证 券	202201140002 1498	阳 光 电 源	2022-01 -14	556,200.00	4,500.00	14	1.80	389.34	-	-
中 信 证 券	202201140002 1500	中 芯 国 际	2022-01 -14	367,848.00	7,200.00	14	1.80	257.49	-	-
中 信 证 券	202201140002 1502	康 泰 生 物	2022-01 -14	168,084.00	1,800.00	14	1.80	117.66	-	-
中 信 证 券	202201140002 1504	华 润 微	2022-01 -14	97,120.00	1,600.00	14	1.80	67.98	-	-
中	202201140002	圣	2022-01	75,080.00	1,000.00	14	1.80	52.56	-	-

信 证 券	2610	湘 生 物	-14							
中 信 证 券	202201140002 2630	芯 原 股 份	2022-01 -14	70,100.00	1,000.00	14	1.80	49.07	-	-
中 信 证 券	202201140002 3520	欣 旺 达	2022-01 -14	154,939.00	4,100.00	14	1.80	108.46	-	-
中 信 证 券	202201140002 3530	天 能 股 份	2022-01 -14	41,470.00	1,000.00	14	1.80	29.03	-	-
中 信 证 券	202201140002 3532	澜 起 科 技	2022-01 -14	211,400.00	2,800.00	14	1.80	147.98	-	-
中 信 证 券	202201140002 3534	华 大 基 因	2022-01 -14	101,180.00	1,000.00	14	1.80	70.83	-	-
中 信 证 券	202201140002 3536	奇 安 信	2022-01 -14	81,020.00	1,000.00	14	1.80	56.71	-	-
中 信 证 券	202201140002 3538	金 山 办 公	2022-01 -14	268,620.00	1,100.00	14	1.80	188.03	-	-
中 信 证 券	202201140002 3540	泰 格 医 药	2022-01 -14	283,636.00	2,300.00	14	1.80	198.55	-	-
中 信 证 券	202201140002 3542	先 导 智 能	2022-01 -14	291,961.00	4,100.00	14	1.80	204.37	-	-
中 信 证 券	202201140002 3544	深 信 服	2022-01 -14	165,980.00	1,000.00	14	1.80	116.19	-	-
中	202201140002	传	2022-01	223,260.00	1,500.00	14	1.80	156.28	-	-

信 证 券	3546	音 控 股	-14							
中 信 证 券	202201140002 3548	迈 瑞 医 疗	2022-01 -14	844,500.00	2,500.00	14	1.80	591.15	-	-
中 信 证 券	202201140002 3550	爱 美 客	2022-01 -14	473,420.00	1,000.00	14	1.80	331.39	-	-
中 信 证 券	202201140002 3552	欧 普 康 视	2022-01 -14	113,620.00	2,300.00	14	1.80	79.53	-	-
中 信 证 券	202201140002 3554	贝 达 药 业	2022-01 -14	84,205.00	1,100.00	14	1.80	58.94	-	-
中 信 证 券	202201140002 3556	君 实 生 物	2022-01 -14	76,500.00	1,000.00	14	1.80	53.55	-	-
中 信 证 券	202201140002 3558	智 飞 生 物	2022-01 -14	486,932.00	4,300.00	14	1.80	340.85	-	-
中 信 证 券	202201140002 3560	亿 纬 锂 能	2022-01 -14	561,000.00	5,000.00	14	1.80	392.70	-	-
中 信 证 券	202201140002 3562	沃 森 生 物	2022-01 -14	395,025.00	6,900.00	14	1.80	276.52	-	-
中 信 证 券	202201140002 3564	寒 武 纪	2022-01 -14	90,550.00	1,000.00	14	1.80	63.39	-	-
中 信 证 券	202201140002 3566	乐 普 医 疗	2022-01 -14	139,776.00	5,600.00	14	1.80	97.84	-	-
中	202201180000	和	2022-01	2,516,301.	809,100.	14	1.40	1,957.1	-	-

信 证 券	1455	辉 光 电	-18	00	00			3		
中 信 证 券	202201180002 5502	乐 普 医 疗	2022-01 -18	69,870.00	3,000.00	14	3.20	124.21	-	-
中 信 证 券	202201180002 5506	欣 旺 达	2022-01 -18	2,613,800. 00	70,000.0 0	14	2.90	4,211.1 3	-	-
中 信 证 券	202201180002 5508	泰 格 医 药	2022-01 -18	244,040.00	2,000.00	14	3.20	433.84	-	-
中 信 证 券	202201180002 5510	和 辉 光 电	2022-01 -18	31,100.00	10,000.0 0	14	1.40	24.19	-	-
中 信 证 券	202201180002 5512	深 信 服	2022-01 -18	1,855,500. 00	10,000.0 0	14	2.90	2,989.4 2	-	-
中 信 证 券	202201200000 9100	先 导 智 能	2022-01 -20	416,271.00	5,700.00	14	1.90	395.46	-	-
中 信 证 券	202201200000 9104	深 信 服	2022-01 -20	178,010.00	1,000.00	14	1.80	160.21	-	-
中 信 证 券	202201200000 9114	三 环 集 团	2022-01 -20	148,592.00	3,700.00	14	1.80	133.73	-	-
中 信 证 券	202201200000 9118	蓝 思 科 技	2022-01 -20	99,450.00	5,100.00	14	1.80	89.51	-	-
中 信 证 券	202201200000 9128	亿 联 网 络	2022-01 -20	84,000.00	1,000.00	14	1.80	75.60	-	-
中	202201200000	中	2022-01	148,230.00	1,000.00	14	1.80	133.41	-	-

信 证 券	9130	科 创 达	-20							
中 信 证 券	202201200000 9136	同 花 顺	2022-01 -20	133,260.00	1,000.00	14	1.80	119.93	-	-
中 信 证 券	202201200000 9142	亿 纬 锂 能	2022-01 -20	660,330.00	6,900.00	14	1.90	627.31	-	-
中 信 证 券	202201200000 9146	乐 普 医 疗	2022-01 -20	114,939.00	4,300.00	14	1.80	103.45	-	-
中 信 证 券	202201200000 9154	亿 纬 锂 能	2022-01 -20	363,660.00	3,800.00	14	1.80	327.29	-	-
中 信 证 券	202201200000 9158	君 实 生 物	2022-01 -20	82,530.00	1,000.00	14	1.80	74.28	-	-
中 信 证 券	202201200000 9164	金 山 办 公	2022-01 -20	274,460.00	1,000.00	14	1.80	247.01	-	-
中 信 证 券	202201200000 9818	先 导 智 能	2022-01 -20	233,696.00	3,200.00	14	1.80	210.33	-	-
中 信 证 券	202201200000 9828	华 大 基 因	2022-01 -20	90,550.00	1,000.00	14	1.80	81.50	-	-
中 信 证 券	202201200000 9834	贝 达 药 业	2022-01 -20	71,100.00	1,000.00	14	1.80	63.99	-	-
中 信 证 券	202201200000 9852	康 泰 生 物	2022-01 -20	122,402.00	1,400.00	14	1.80	110.16	-	-
中	202201200000	欧	2022-01	74,868.00	1,700.00	14	1.80	67.38	-	-

信 证 券	9856	普 康 视	-20							
中 信 证 券	202201200000 9858	泰 格 医 药	2022-01 -20	214,866.00	1,800.00	14	1.80	193.38	-	-
中 信 证 券	202201200000 9860	阳 光 电 源	2022-01 -20	415,684.00	3,400.00	14	1.80	374.12	-	-
中 信 证 券	202201200000 9866	沃 森 生 物	2022-01 -20	291,222.00	5,400.00	14	1.80	262.10	-	-
中 信 证 券	202201200000 9872	汇 川 技 术	2022-01 -20	631,284.00	9,300.00	14	1.90	599.72	-	-
中 信 证 券	202201200000 9874	智 飞 生 物	2022-01 -20	267,500.00	2,500.00	14	1.80	240.75	-	-
中 信 证 券	202201200000 9876	汇 川 技 术	2022-01 -20	359,764.00	5,300.00	14	1.80	323.78	-	-
中 信 证 券	202201200000 9884	中 芯 国 际	2022-01 -20	284,295.00	5,500.00	14	1.80	255.87	-	-
中 信 证 券	202201200000 9892	华 润 微	2022-01 -20	75,738.00	1,300.00	14	1.80	68.17	-	-
中 信 证 券	202201200000 9896	卓 胜 微	2022-01 -20	268,710.00	1,000.00	14	1.80	241.84	-	-
中 信 证 券	202201200001 0728	康 龙 化 成	2022-01 -20	127,910.00	1,000.00	14	1.80	115.12	-	-
中	202201200001	宁	2022-01	1,195,173.	2,100.00	14	1.90	1,135.4	-	-

信 证 券	0736	德 时 代	-20	00				1		
中 信 证 券	202201200001 0740	迈 瑞 医 疗	2022-01 -20	709,880.00	2,000.00	14	1.80	638.90	-	-
中 信 证 券	202201200001 0744	传 音 控 股	2022-01 -20	167,220.00	1,200.00	14	1.80	150.49	-	-
中 信 证 券	202201200001 0752	中 国 通 号	2022-01 -20	62,625.00	12,500.0 0	14	1.80	56.37	-	-
中 信 证 券	202201200001 0760	澜 起 科 技	2022-01 -20	174,042.00	2,200.00	14	1.80	156.64	-	-
中 信 证 券	202201200001 0766	中 微 公 司	2022-01 -20	149,760.00	1,300.00	14	1.80	134.78	-	-
中 信 证 券	202201200001 0798	蓝 思 科 技	2022-01 -20	741,000.00	38,000.0 0	14	2.40	889.20	-	-
中 信 证 券	202201200001 1206	三 环 集 团	2022-01 -20	2,124,464. 00	52,900.0 0	14	1.80	1,912.0 1	-	-
中 信 证 券	202201200001 1212	迈 瑞 医 疗	2022-01 -20	3,868,846. 00	10,900.0 0	14	1.80	3,481.9 6	-	-
中 信 证 券	202201200001 1214	泰 格 医 药	2022-01 -20	3,903,399. 00	32,700.0 0	14	1.80	3,513.0 6	-	-
中 信 证 券	202201240000 8824	亿 纬 锂 能	2022-01 -24	11,378,862 .00	113,800. 00	14	1.90	8,407.7 1	-	-
中	202201240000	阳	2022-01	12,249,167	93,100.0	14	1.90	9,050.7	-	-

信 证 券	9776	光 电 源	-24	.00	0			7		
中 信 证 券	202201240000 9790	中 伟 股 份	2022-01 -24	1,362,700. 00	10,000.0 0	14	2.90	1,536.8 2	-	-
中 信 证 券	202201240001 0984	迈 瑞 医 疗	2022-01 -24	2,328,612. 00	6,900.00	14	1.90	1,720.5 9	-	-
中 信 证 券	202201250001 1498	华 大 基 因	2022-01 -25	2,881,160. 00	34,000.0 0	14	2.80	3,137.2 6	-	-
中 信 证 券	202201270000 0920	华 大 基 因	2022-01 -27	1,663,600. 00	20,000.0 0	14	3.30	2,134.9 5	-	-
中 信 证 券	202201270001 1431	亿 纬 锂 能	2022-01 -27	476,500.00	5,000.00	14	3.20	592.98	-	-
中 信 证 券	202201270001 1433	欣 旺 达	2022-01 -27	826,390.00	23,000.0 0	14	2.80	899.85	-	-
中 信 证 券	202201270001 1501	中 伟 股 份	2022-01 -27	1,300,600. 00	10,000.0 0	14	1.80	910.42	-	-
中 信 证 券	202201280002 2166	欣 旺 达	2022-01 -28	144,197.00	4,100.00	14	1.80	100.94	-	-
中 信 证 券	202201280002 2168	和 辉 光 电	2022-01 -28	29,000.00	10,000.0 0	14	1.80	20.30	-	-
中 信 证 券	202202070004 7113	深 信 服	2022-02 -07	153,170.00	1,000.00	14	1.80	107.22	-	-
中	202202070004	先	2022-02	411,768.00	5,700.00	14	1.90	304.25	-	-

信 证 券	7115	导 智 能	-07							
中 信 证 券	202202070004 7117	三 环 集 团	2022-02 -07	1,976,873. 00	52,900.0 0	14	1.80	1,383.8 1	-	-
中 信 证 券	202202070004 7119	中 科 创 达	2022-02 -07	140,350.00	1,000.00	14	1.80	98.25	-	-
中 信 证 券	202202070004 7121	先 导 智 能	2022-02 -07	231,168.00	3,200.00	14	1.80	161.82	-	-
中 信 证 券	202202070004 7123	欧 普 康 视	2022-02 -07	64,260.00	1,700.00	14	1.80	44.98	-	-
中 信 证 券	202202070004 7125	贝 达 药 业	2022-02 -07	62,040.00	1,000.00	14	1.80	43.43	-	-
中 信 证 券	202202070004 7127	蓝 思 科 技	2022-02 -07	76,653.00	5,100.00	14	1.80	53.66	-	-
中 信 证 券	202202070004 7129	卓 胜 微	2022-02 -07	262,220.00	1,000.00	14	1.80	183.55	-	-
中 信 证 券	202202070004 7131	三 环 集 团	2022-02 -07	138,269.00	3,700.00	14	1.80	96.79	-	-
中 信 证 券	202202070004 7133	中 国 通 号	2022-02 -07	61,375.00	12,500.0 0	14	1.80	42.96	-	-
中 信 证 券	202202070004 7135	迈 瑞 医 疗	2022-02 -07	3,581,413. 00	10,900.0 0	14	1.80	2,506.9 9	-	-
中	202202070004	华	2022-02	86,290.00	1,000.00	14	1.80	60.40	-	-

信 证 券	7137	大 基 因	-07							
中 信 证 券	202202070004 7139	泰 格 医 药	2022-02 -07	3,423,036. 00	32,700.0 0	14	1.80	2,396.1 3	-	-
中 信 证 券	202202070004 7141	澜 起 科 技	2022-02 -07	158,312.00	2,200.00	14	1.80	110.82	-	-
中 信 证 券	202202070004 7143	迈 瑞 医 疗	2022-02 -07	657,140.00	2,000.00	14	1.80	460.00	-	-
中 信 证 券	202202070004 7145	康 泰 生 物	2022-02 -07	115,108.00	1,400.00	14	1.80	80.58	-	-
中 信 证 券	202202070004 7147	亿 联 网 络	2022-02 -07	78,250.00	1,000.00	14	1.80	54.78	-	-
中 信 证 券	202202070004 7149	康 龙 化 成	2022-02 -07	121,180.00	1,000.00	14	1.80	84.83	-	-
中 信 证 券	202202070004 7151	宁 德 时 代	2022-02 -07	1,216,824. 00	2,100.00	14	1.90	899.10	-	-
中 信 证 券	202202070004 7173	泰 格 医 药	2022-02 -07	188,424.00	1,800.00	14	1.80	131.90	-	-
中 信 证 券	202202070004 7175	汇 川 技 术	2022-02 -07	560,232.00	9,300.00	14	1.90	413.95	-	-
中 信 证 券	202202070004 7177	阳 光 电 源	2022-02 -07	383,826.00	3,400.00	14	1.80	268.68	-	-
中	202202070004	乐	2022-02	89,483.00	4,300.00	14	1.80	62.64	-	-

信 证 券	7179	普 医 疗	-07								
中 信 证 券	202202070004 7181	智 飞 生 物	2022-02 -07	276,175.00	2,500.00	14	1.80	193.32	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7183	亿 纬 锂 能	2022-02 -07	650,670.00	6,900.00	14	1.90	480.77	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7185	汇 川 技 术	2022-02 -07	319,272.00	5,300.00	14	1.80	223.49	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7187	亿 纬 锂 能	2022-02 -07	358,340.00	3,800.00	14	1.80	250.84	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7189	同 花 顺	2022-02 -07	118,430.00	1,000.00	14	1.80	82.90	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7191	沃 森 生 物	2022-02 -07	271,296.00	5,400.00	14	1.80	189.91	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7193	中 微 公 司	2022-02 -07	156,039.00	1,300.00	14	1.80	109.23	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7205	迈 瑞 医 疗	2022-02 -07	2,267,133. 00	6,900.00	14	1.90	1,675.1 6	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7209	阳 光 电 源	2022-02 -07	10,510,059 .00	93,100.0 0	14	1.90	7,765.7 7	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7213	中 伟 股 份	2022-02 -07	1,239,000. 00	10,000.0 0	14	2.90	1,397.3 2	-	-	
中	202202070004	传	2022-02	159,744.00	1,200.00	14	1.80	111.82	-	-	

信 证 券	7215	音 控 股	-07								
中 信 证 券	202202070004 7221	君 实 生 物	2022-02 -07	58,900.00	1,000.00	14	1.80	41.23	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7225	金 山 办 公	2022-02 -07	242,750.00	1,000.00	14	1.80	169.93	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7229	亿 纬 锂 能	2022-02 -07	10,731,340 .00	113,800. 00	14	1.90	7,929.2 7	-	-	
中 信 证 券	202202070004 7231	华 润 微	2022-02 -07	72,033.00	1,300.00	14	1.80	50.42	-	-	
中 信 证 券	202202070005 0495	乐 普 医 疗	2022-02 -07	62,430.00	3,000.00	14	3.00	72.84	-	-	
中 信 证 券	202202070005 0497	蓝 思 科 技	2022-02 -07	571,140.00	38,000.0 0	14	2.20	488.64	-	-	
中 信 证 券	202202070005 0499	深 信 服	2022-02 -07	1,531,700. 00	10,000.0 0	14	2.10	1,250.8 9	-	-	
中 信 证 券	202202070005 0501	欣 旺 达	2022-02 -07	2,591,400. 00	70,000.0 0	14	3.10	3,124.0 8	-	-	
中 信 证 券	202202070005 0503	泰 格 医 药	2022-02 -07	209,360.00	2,000.00	14	2.00	162.84	-	-	
中 信 证 券	202202070005 0505	和 辉 光 电	2022-02 -07	29,400.00	10,000.0 0	14	1.20	13.72	-	-	
中	202202070005	和	2022-02	2,378,754.	809,100.	14	1.20	1,110.0	-	-	

信 证 券	0509	辉 光 电	-07	00	00			9		
中 信 证 券	202202070005 5751	中 芯 国 际	2022-02 -07	274,835.00	5,500.00	14	1.80	192.38	-	-
中 信 证 券	202202080001 3738	华 大 基 因	2022-02 -08	2,945,420. 00	34,000.0 0	14	3.30	3,779.9 6	-	-
中 信 证 券	202202100001 2778	中 伟 股 份	2022-02 -10	1,159,900. 00	10,000.0 0	14	1.80	811.93	-	-
中 信 证 券	202202100001 3364	欣 旺 达	2022-02 -10	803,390.00	23,000.0 0	14	3.10	968.53	-	-
中 信 证 券	202202100001 3366	亿 纬 锂 能	2022-02 -10	429,350.00	5,000.00	14	2.90	484.21	-	-
中 信 证 券	202202100001 3368	华 大 基 因	2022-02 -10	1,735,400. 00	20,000.0 0	14	3.30	2,227.1 0	-	-
中 信 证 券	202202110002 0194	和 辉 光 电	2022-02 -11	29,400.00	10,000.0 0	14	1.80	20.58	-	-
中 信 证 券	202202110002 0208	欣 旺 达	2022-02 -11	137,719.00	4,100.00	14	1.80	96.40	-	-
中 信 证 券	202202210003 8027	阳 光 电 源	2022-02 -21	9,873,255. 00	93,100.0 0	14	1.90	7,295.2 4	-	-
中 信 证 券	202202210003 8039	迈 瑞 医 疗	2022-02 -21	3,498,900. 00	10,900.0 0	14	1.80	2,449.2 3	-	-
中	202202210003	三	2022-02	1,809,180.	52,900.0	14	1.80	1,266.4	-	-

信 证 券	8043	环 集 团	-21	00	0			3		
中 信 证 券	202202210003 8045	泰 格 医 药	2022-02 -21	3,268,365. 00	32,700.0 0	14	1.80	2,287.8 6	-	-
中 信 证 券	202202210003 8049	先 导 智 能	2022-02 -21	354,255.00	5,700.00	14	1.90	261.76	-	-
中 信 证 券	202202210003 8051	宁 德 时 代	2022-02 -21	1,071,000. 00	2,100.00	14	1.90	791.35	-	-
中 信 证 券	202202210003 8053	迈 瑞 医 疗	2022-02 -21	2,214,900. 00	6,900.00	14	1.90	1,636.5 7	-	-
中 信 证 券	202202210003 8055	亿 纬 锂 能	2022-02 -21	592,365.00	6,900.00	14	1.90	437.69	-	-
中 信 证 券	202202210003 8057	亿 纬 锂 能	2022-02 -21	9,769,730. 00	113,800. 00	14	1.90	7,218.7 4	-	-
中 信 证 券	202202210003 8059	汇 川 技 术	2022-02 -21	597,990.00	9,300.00	14	1.90	441.85	-	-
中 信 证 券	202202210004 3101	中 伟 股 份	2022-02 -21	1,232,900. 00	10,000.0 0	14	2.90	1,390.4 4	-	-
中 信 证 券	202202210004 7183	蓝 思 科 技	2022-02 -21	570,380.00	38,000.0 0	14	2.20	487.99	-	-
中 信 证 券	202202210004 7185	泰 格 医 药	2022-02 -21	199,900.00	2,000.00	14	2.00	155.48	-	-
中	202202210004	乐	2022-02	64,890.00	3,000.00	14	2.70	68.13	-	-

信 证 券	7187	普 医 疗	-21							
中 信 证 券	202202210004 7189	深 信 服	2022-02 -21	1,467,200. 00	10,000.0 0	14	2.10	1,198.2 1	-	-
中 信 证 券	202202210004 7191	欣 旺 达	2022-02 -21	2,434,600. 00	70,000.0 0	14	3.00	2,840.3 7	-	-
中 信 证 券	202202220000 1298	欧 普 康 视	2022-02 -22	39,800.00	1,000.00	14	3.00	26.53	-	-
中 信 证 券	202202220001 3179	华 大 基 因	2022-02 -22	2,909,380. 00	34,000.0 0	14	3.00	3,394.2 8	-	-
中 信 证 券	202202240000 0801	沃 森 生 物	2022-02 -24	45,000.00	1,000.00	28	1.80	63.00	-	-
中 信 证 券	202202240000 0808	三 环 集 团	2022-02 -24	34,610.00	1,000.00	28	1.90	51.15	-	-
中 信 证 券	202202240000 0815	先 导 智 能	2022-02 -24	63,940.00	1,000.00	28	2.50	124.33	-	-
中 信 证 券	202202240000 0818	智 飞 生 物	2022-02 -24	117,040.00	1,000.00	28	2.10	191.17	-	-
中 信 证 券	202202240001 0293	亿 纬 锂 能	2022-02 -24	429,950.00	5,000.00	14	2.90	484.89	-	-
中 信 证 券	202202240001 0295	欣 旺 达	2022-02 -24	800,170.00	23,000.0 0	14	3.10	964.65	-	-
中	202202240001	华	2022-02	1,671,200.	20,000.0	14	3.10	2,014.7	-	-

信 证 券	0297	大 基 因	-24	00	0			2		
中 信 证 券	202202240001 2431	中 伟 股 份	2022-02 -24	1,260,000. 00	10,000.0 0	14	1.80	882.00	-	-
中 信 证 券	202202250001 7917	和 辉 光 电	2022-02 -25	29,400.00	10,000.0 0	14	1.80	20.58	-	-
中 信 证 券	202202250001 7921	欣 旺 达	2022-02 -25	148,420.00	4,100.00	14	1.80	103.89	-	-
中 信 证 券	202203010000 1225	三 环 集 团	2022-03 -01	722,190.00	21,000.0 0	14	2.00	561.70	-	-
中 信 证 券	202203010000 3209	欧 普 康 视	2022-02 -22	39,800.00	1,000.00	8	3.00	26.53	-	-
中 信 证 券	202203030000 1534	深 信 服	2022-03 -03	856,140.00	6,000.00	14	2.10	699.18	-	-
中 信 证 券	202203070003 3580	亿 纬 锂 能	2022-03 -07	516,051.00	6,900.00	14	1.90	381.30	-	-
中 信 证 券	202203070003 3582	汇 川 技 术	2022-03 -07	558,000.00	9,300.00	14	1.90	412.30	-	-
中 信 证 券	202203070003 3584	宁 德 时 代	2022-03 -07	955,269.00	2,100.00	14	1.90	705.84	-	-
中 信 证 券	202203070003 5242	先 导 智 能	2022-03 -07	325,413.00	5,700.00	14	1.90	240.44	-	-
中	202203070004	深	2022-03	1,325,500.	10,000.0	14	2.10	1,082.4	-	-

信 证 券	1948	信 服	-07	00	0			9		
中 信 证 券	202203070004 1950	蓝 思 科 技	2022-03 -07	516,800.00	38,000.0 0	14	2.10	422.05	-	-
中 信 证 券	202203070004 3554	阳 光 电 源	2022-03 -07	11,536,952 .00	93,100.0 0	14	1.90	8,524.5 3	-	-
中 信 证 券	202203070004 3556	亿 纬 锂 能	2022-03 -07	8,511,102. 00	113,800. 00	14	1.90	6,288.7 6	-	-
中 信 证 券	202203070004 4388	泰 格 医 药	2022-03 -07	2,984,202. 00	32,700.0 0	14	1.80	2,088.9 4	-	-
中 信 证 券	202203080001 3112	华 大 基 因	2022-03 -08	2,615,280. 00	34,000.0 0	14	3.20	3,254.5 7	-	-
中 信 证 券	202203100001 1752	亿 纬 锂 能	2022-03 -10	375,750.00	5,000.00	14	2.70	394.54	-	-
中 信 证 券	202203100001 1756	华 大 基 因	2022-03 -10	1,611,000. 00	20,000.0 0	14	3.20	2,004.8 0	-	-
中 信 证 券	202203100001 2298	中 伟 股 份	2022-03 -10	1,160,000. 00	10,000.0 0	14	1.80	812.00	-	-
中 信 证 券	202203110001 7350	欣 旺 达	2022-03 -11	117,260.00	4,100.00	14	1.80	82.08	-	-
中 信 证 券	202203110001 7354	和 辉 光 电	2022-03 -11	31,400.00	10,000.0 0	14	1.80	21.98	-	-
中	202203150000	乐	2022-03	1,922,150.	92,500.0	28	3.10	4,634.5	-	-

信 证 券	1204	普 医 疗	-15	00	0			2		
中 信 证 券	202203170000 4718	深 信 服	2022-03 -17	719,880.00	6,000.00	14	3.00	839.86	-	-
中 信 证 券	202203210002 8633	宁 德 时 代	2022-03 -21	1,092,000. 00	2,100.00	14	1.90	922.14	-	-
中 信 证 券	202203210002 8639	汇 川 技 术	2022-03 -21	535,680.00	9,300.00	14	1.90	452.35	-	-
中 信 证 券	202203210002 8649	先 导 智 能	2022-03 -21	346,332.00	5,700.00	14	1.90	292.46	-	-
中 信 证 券	202203210002 8651	亿 纬 锂 能	2022-03 -21	589,260.00	6,900.00	14	1.90	497.60	-	-
中 信 证 券	202203210003 0577	泰 格 医 药	2022-03 -21	3,085,899. 00	32,700.0 0	14	1.80	2,468.7 2	-	-
中 信 证 券	202203210003 5975	蓝 思 科 技	2022-03 -21	469,680.00	38,000.0 0	14	2.30	480.11	-	-
中 信 证 券	202203210003 5979	深 信 服	2022-03 -21	1,206,400. 00	10,000.0 0	14	2.00	1,072.3 5	-	-
中 信 证 券	202203210003 6093	亿 纬 锂 能	2022-03 -21	9,718,520. 00	113,800. 00	14	1.90	8,206.7 5	-	-
中 信 证 券	202203210003 6099	阳 光 电 源	2022-03 -21	10,927,147 .00	93,100.0 0	14	1.90	9,227.3 7	-	-
中	202203220000	沃	2022-03	5,780,432.	102,200.	14	1.60	3,853.6	-	-

信 证 券	0938	森 生 物	-22	00	00			2		
中 信 证 券	202203220000 0943	乐 普 医 疗	2022-03 -22	20,900.00	1,000.00	14	3.30	28.74	-	-
中 信 证 券	202203220001 1703	华 大 基 因	2022-03 -22	2,863,140. 00	34,000.0 0	14	3.50	4,175.4 1	-	-
中 信 证 券	202203240001 0023	中 伟 股 份	2022-03 -24	1,259,200. 00	10,000.0 0	14	1.80	881.44	-	-
中 信 证 券	202203240001 0491	先 导 智 能	2022-03 -24	59,330.00	1,000.00	28	1.90	87.68	-	-
中 信 证 券	202203240001 0497	沃 森 生 物	2022-03 -24	58,970.00	1,000.00	28	1.40	64.21	-	-
中 信 证 券	202203240001 0499	智 飞 生 物	2022-03 -24	141,300.00	1,000.00	28	1.00	109.90	-	-
中 信 证 券	202203240001 0503	三 环 集 团	2022-03 -24	29,740.00	1,000.00	28	2.70	62.45	-	-
中 信 证 券	202203240001 0507	华 大 基 因	2022-03 -24	1,682,600. 00	20,000.0 0	14	3.50	2,290.2 1	-	-
中 信 证 券	202203240001 0509	亿 纬 锂 能	2022-03 -24	407,250.00	5,000.00	14	2.20	348.43	-	-
中 信 证 券	202203250001 5834	和 辉 光 电	2022-03 -25	30,400.00	10,000.0 0	14	1.80	21.28	-	-
中	202203250001	欣	2022-03	117,629.00	4,100.00	14	1.80	82.34	-	-

信 证 券	5838	旺 达	-25								
中 信 证 券	202203310000 0900	卓 胜 微	2022-03 -31	251,904.00	1,200.00	28	1.80	352.67	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0901	智 飞 生 物	2022-03 -31	538,200.00	3,900.00	28	1.80	753.48	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0909	康 泰 生 物	2022-03 -31	186,500.00	2,000.00	28	1.80	261.10	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0911	深 信 服	2022-03 -31	111,560.00	1,000.00	28	1.80	156.18	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0912	欣 旺 达	2022-03 -31	162,250.00	5,900.00	28	1.80	227.15	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0925	康 龙 化 成	2022-03 -31	153,400.00	1,300.00	28	1.80	214.76	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0934	亿 联 网 络	2022-03 -31	139,950.00	1,800.00	28	1.80	195.93	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0935	迈 瑞 医 疗	2022-03 -31	768,125.00	2,500.00	28	1.80	1,075.3 8	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0937	华 大 基 因	2022-03 -31	80,690.00	1,000.00	14	1.80	56.48	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0939	卓 胜 微	2022-03 -31	209,920.00	1,000.00	14	1.80	146.94	-	-	
中	202203310000	康	2022-03	118,000.00	1,000.00	14	1.80	82.60	-	-	

信 证 券	0941	龙 化 成	-31							
中 信 证 券	202203310000 0943	北 京 君 正	2022-03 -31	91,470.00	1,000.00	14	1.80	64.03	-	-
中 信 证 券	202203310000 0944	沃 森 生 物	2022-03 -31	296,298.00	5,400.00	14	1.80	207.41	-	-
中 信 证 券	202203310000 0946	泰 格 医 药	2022-03 -31	193,680.00	1,800.00	14	1.80	135.58	-	-
中 信 证 券	202203310000 0947	阳 光 电 源	2022-03 -31	364,684.00	3,400.00	14	1.80	255.28	-	-
中 信 证 券	202203310000 0949	亿 纬 锂 能	2022-03 -31	306,546.00	3,800.00	14	1.80	214.58	-	-
中 信 证 券	202203310000 0950	乐 普 医 疗	2022-03 -31	86,731.00	4,300.00	14	1.80	60.71	-	-
中 信 证 券	202203310000 0951	汇 川 技 术	2022-03 -31	302,100.00	5,300.00	14	1.80	211.47	-	-
中 信 证 券	202203310000 0953	智 飞 生 物	2022-03 -31	345,000.00	2,500.00	14	1.80	241.50	-	-
中 信 证 券	202203310000 0954	中 科 创 达	2022-03 -31	99,200.00	1,000.00	14	1.80	69.44	-	-
中 信 证 券	202203310000 0955	亿 联 网 络	2022-03 -31	77,750.00	1,000.00	14	1.80	54.43	-	-
中	202203310000	贝	2022-03	55,910.00	1,000.00	14	1.80	39.14	-	-

信 证 券	0957	达 药 业	-31								
中 信 证 券	202203310000 0959	康 泰 生 物	2022-03 -31	130,550.00	1,400.00	14	1.80	91.39	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0961	蓝 思 科 技	2022-03 -31	59,517.00	5,100.00	14	1.80	41.66	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0963	三 环 集 团	2022-03 -31	103,563.00	3,700.00	14	1.80	72.49	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0964	深 信 服	2022-03 -31	111,560.00	1,000.00	14	1.80	78.09	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0965	先 导 智 能	2022-03 -31	187,008.00	3,200.00	14	1.80	130.91	-	-	
中 信 证 券	202203310000 0966	贝 达 药 业	2022-03 -31	67,092.00	1,200.00	28	1.80	93.93	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1000	澜 起 科 技	2022-03 -31	148,060.00	2,200.00	14	1.80	103.64	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1005	金 山 办 公	2022-03 -31	187,660.00	1,000.00	14	1.80	131.36	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1014	中 国 通 号	2022-03 -31	55,625.00	12,500.00	14	1.80	38.94	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1023	沪 硅 产 业	2022-03 -31	52,632.00	2,400.00	14	1.80	36.84	-	-	
中	202203310000	君	2022-03	87,190.00	1,000.00	14	1.80	61.03	-	-	

信 证 券	1034	实 生 物	-31								
中 信 证 券	202203310000 1039	华 润 微	2022-03 -31	71,201.00	1,300.00	14	1.80	49.84	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1051	中 芯 国 际	2022-03 -31	253,495.00	5,500.00	14	1.80	177.45	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1059	康 泰 生 物	2022-03 -31	279,750.00	3,000.00	14	3.40	369.89	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1078	珠 海 冠 宇	2022-03 -31	93,030.00	3,000.00	14	1.80	65.12	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1090	时 代 电 气	2022-03 -31	164,250.00	3,000.00	14	1.80	114.98	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1110	泰 格 医 药	2022-03 -31	279,760.00	2,600.00	28	1.80	391.66	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1120	迈 瑞 医 疗	2022-03 -31	614,500.00	2,000.00	14	1.80	430.15	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1130	传 音 控 股	2022-03 -31	114,732.00	1,200.00	14	1.80	80.31	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1132	中 微 公 司	2022-03 -31	151,385.00	1,300.00	14	1.80	105.97	-	-	
中 信 证 券	202203310000 1134	时 代 电 气	2022-03 -31	54,750.00	1,000.00	28	1.80	76.65	-	-	
中	202203310000	深	2022-03	669,360.00	6,000.00	14	2.80	728.86	-	-	

信 证 券	6260	信 服	-31								
中 信 证 券	202204060005 1677	乐 普 医 疗	2022-04 -06	20,000.00	1,000.00	14	3.30	25.67	-	-	
中 信 证 券	202204060005 3997	沃 森 生 物	2022-04 -06	5,902,050. 00	102,200. 00	14	2.50	5,738.1 0	-	-	
中 信 证 券	202204060005 3999	华 大 基 因	2022-04 -06	2,781,540. 00	34,000.0 0	14	3.40	3,677.8 1	-	-	
中 信 证 券	202204060005 4001	深 信 服	2022-04 -06	1,109,700. 00	10,000.0 0	14	3.30	1,424.1 2	-	-	
中 信 证 券	202204060005 6317	宁 德 时 代	2022-04 -06	1,067,157. 00	2,100.00	14	1.90	788.51	-	-	
中 信 证 券	202204060005 6325	先 导 智 能	2022-04 -06	308,484.00	5,700.00	14	1.90	227.94	-	-	
中 信 证 券	202204060005 6335	亿 纬 锂 能	2022-04 -06	547,170.00	6,900.00	14	1.90	404.30	-	-	
中 信 证 券	202204060005 6337	亿 纬 锂 能	2022-04 -06	9,024,340. 00	113,800. 00	14	1.90	6,667.9 8	-	-	
中 信 证 券	202204060005 7971	汇 川 技 术	2022-04 -06	524,985.00	9,300.00	14	1.90	387.91	-	-	
中 信 证 券	202204060005 9905	阳 光 电 源	2022-04 -06	9,550,198. 00	93,100.0 0	14	1.90	7,056.5 4	-	-	
中	202204060005	泰	2022-04	3,462,276.	32,700.0	14	1.80	2,423.5	-	-	

信 证 券	9907	格 医 药	-06	00	0			9		
中 信 证 券	202204070001 2660	中 伟 股 份	2022-04 -07	1,125,100. 00	10,000.0 0	14	1.80	787.57	-	-
中 信 证 券	202204070001 3064	华 大 基 因	2022-04 -07	1,589,000. 00	20,000.0 0	14	3.40	2,101.0 1	-	-
中 信 证 券	202204070001 3066	亿 纬 锂 能	2022-04 -07	373,400.00	5,000.00	14	3.10	450.15	-	-
中 信 证 券	202204080001 4115	欣 旺 达	2022-04 -08	102,746.00	4,100.00	14	1.80	71.92	-	-
中 信 证 券	202204080001 5425	和 辉 光 电	2022-04 -08	30,300.00	10,000.0 0	14	1.80	21.21	-	-
中 信 证 券	202204110000 7878	中 科 创 达	2022-03 -31	305.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202204140000 5515	康 泰 生 物	2022-04 -14	241,500.00	3,000.00	14	3.20	300.53	-	-
中 信 证 券	202204140000 5535	贝 达 药 业	2022-04 -14	46,580.00	1,000.00	14	1.80	32.61	-	-
中 信 证 券	202204140000 5537	深 信 服	2022-04 -14	94,940.00	1,000.00	14	1.80	66.46	-	-
中 信 证 券	202204140000 5539	中 国 通 号	2022-04 -14	55,875.00	12,500.0 0	14	1.80	39.11	-	-
中	202204140000	澜	2022-04	124,762.00	2,200.00	14	1.80	87.33	-	-

信 证 券	5541	起 科 技	-14							
中 信 证 券	202204140000 5543	中 科 创 达	2022-04 -14	90,510.00	1,000.00	14	1.80	63.36	-	-
中 信 证 券	202204140000 5545	卓 胜 微	2022-04 -14	182,330.00	1,000.00	14	1.80	127.63	-	-
中 信 证 券	202204140000 5547	康 龙 化 成	2022-04 -14	115,900.00	1,000.00	14	1.80	81.13	-	-
中 信 证 券	202204140000 5549	智 飞 生 物	2022-04 -14	290,000.00	2,500.00	14	1.80	203.00	-	-
中 信 证 券	202204140000 5551	迈 瑞 医 疗	2022-04 -14	658,000.00	2,000.00	14	1.80	460.60	-	-
中 信 证 券	202204140000 5553	先 导 智 能	2022-04 -14	157,536.00	3,200.00	14	1.80	110.28	-	-
中 信 证 券	202204140000 5555	泰 格 医 药	2022-04 -14	180,738.00	1,800.00	14	1.80	126.52	-	-
中 信 证 券	202204140000 5557	君 实 生 物	2022-04 -14	76,400.00	1,000.00	14	1.80	53.48	-	-
中 信 证 券	202204140000 5587	康 泰 生 物	2022-04 -14	112,700.00	1,400.00	14	1.80	78.89	-	-
中 信 证 券	202204140000 6223	亿 纬 锂 能	2022-04 -14	276,146.00	3,800.00	14	1.80	193.30	-	-
中	202204140000	华	2022-04	78,400.00	1,000.00	14	1.80	54.88	-	-

信 证 券	6225	大 基 因	-14							
中 信 证 券	202204140000 6227	阳 光 电 源	2022-04 -14	299,540.00	3,400.00	14	1.80	209.68	-	-
中 信 证 券	202204140000 6229	华 润 微	2022-04 -14	62,660.00	1,300.00	14	1.80	43.86	-	-
中 信 证 券	202204140000 6231	蓝 思 科 技	2022-04 -14	53,754.00	5,100.00	14	1.80	37.63	-	-
中 信 证 券	202204140000 6233	三 环 集 团	2022-04 -14	102,379.00	3,700.00	14	1.80	71.67	-	-
中 信 证 券	202204140000 6235	金 山 办 公	2022-04 -14	184,100.00	1,000.00	14	1.80	128.87	-	-
中 信 证 券	202204140000 6237	沪 硅 产 业	2022-04 -14	54,720.00	2,400.00	14	1.80	38.30	-	-
中 信 证 券	202204140000 6239	中 芯 国 际	2022-04 -14	240,185.00	5,500.00	14	1.80	168.13	-	-
中 信 证 券	202204140000 6241	沃 森 生 物	2022-04 -14	265,194.00	5,400.00	14	1.80	185.64	-	-
中 信 证 券	202204140000 6243	亿 联 网 络	2022-04 -14	74,990.00	1,000.00	14	1.80	52.49	-	-
中 信 证 券	202204140000 6245	珠 海 冠 宇	2022-04 -14	81,180.00	3,000.00	14	1.80	56.83	-	-
中	202204140000	时	2022-04	134,370.00	3,000.00	14	1.80	94.06	-	-

信 证 券	6247	代 电 气	-14							
中 信 证 券	202204140000 6249	传 音 控 股	2022-04 -14	106,800.00	1,200.00	14	1.80	74.76	-	-
中 信 证 券	202204140000 6251	北 京 君 正	2022-04 -14	81,830.00	1,000.00	14	1.80	57.28	-	-
中 信 证 券	202204140000 6253	汇 川 技 术	2022-04 -14	286,359.00	5,300.00	14	1.80	200.45	-	-
中 信 证 券	202204140000 6255	中 微 公 司	2022-04 -14	140,530.00	1,300.00	14	1.80	98.37	-	-
中 信 证 券	202204140000 6257	乐 普 医 疗	2022-04 -14	81,184.00	4,300.00	14	1.80	56.83	-	-
中 信 证 券	202204140000 6913	深 信 服	2022-04 -14	569,640.00	6,000.00	14	3.20	708.89	-	-
中 信 证 券	202204200003 9110	阳 光 电 源	2022-04 -20	6,710,648. 00	93,100.0 0	14	1.90	5,312.5 9	-	-
中 信 证 券	202204200003 9112	宁 德 时 代	2022-04 -20	854,700.00	2,100.00	14	1.90	676.64	-	-
中 信 证 券	202204200003 9134	华 大 基 因	2022-04 -20	2,484,380. 00	34,000.0 0	14	3.70	3,830.0 9	-	-
中 信 证 券	202204200004 8206	沃 森 生 物	2022-04 -20	5,833,576. 00	102,200. 00	14	2.60	6,319.7 0	-	-
中	202204200004	乐	2022-04	19,080.00	1,000.00	14	3.40	27.03	-	-

信 证 券	8216	普 医 疗	-20							
中 信 证 券	202204200004 8250	深 信 服	2022-04 -20	1,001,000. 00	10,000.0 0	14	3.50	1,459.7 9	-	-
中 信 证 券	202204200004 9866	泰 格 医 药	2022-04 -20	3,168,303. 00	32,700.0 0	14	1.80	2,376.2 3	-	-
中 信 证 券	202204200004 9880	亿 纬 锂 能	2022-04 -20	7,692,880. 00	113,800. 00	14	1.90	6,090.1 9	-	-
中 信 证 券	202204200004 9888	亿 纬 锂 能	2022-04 -20	466,440.00	6,900.00	14	1.90	369.27	-	-
中 信 证 券	202204200004 9902	汇 川 技 术	2022-04 -20	494,295.00	9,300.00	14	1.90	391.32	-	-
中 信 证 券	202204200004 9906	先 导 智 能	2022-04 -20	267,330.00	5,700.00	14	1.90	211.64	-	-
中 信 证 券	202204210001 0847	华 大 基 因	2022-04 -21	1,400,000. 00	20,000.0 0	14	3.70	2,014.4 4	-	-
中 信 证 券	202204210001 0867	沃 森 生 物	2022-04 -21	56,250.00	1,000.00	28	2.50	109.38	-	-
中 信 证 券	202204210001 0873	三 环 集 团	2022-04 -21	28,100.00	1,000.00	28	3.60	78.68	-	-
中 信 证 券	202204210001 1095	亿 纬 锂 能	2022-04 -21	322,550.00	5,000.00	14	3.00	376.31	-	-
中	202204210001	中	2022-04	830,900.00	10,000.0	14	1.80	581.63	-	-

信 证 券	1159	伟 股 份	-21		0					
中 信 证 券	202204220001 5198	和 辉 光 电	2022-04 -22	28,400.00	10,000.0 0	14	1.80	19.88	-	-
中 信 证 券	202204220001 5200	欣 旺 达	2022-04 -22	89,749.00	4,100.00	14	1.80	62.82	-	-
中 信 证 券	202204250000 6226	沃 森 生 物	2022-04 -21	27.00	-	28	2.50	-	-	-
中 信 证 券	202204250000 6326	沃 森 生 物	2022-04 -20	2,759.40	-	14	2.60	-	-	-
中 信 证 券	202204250000 6602	沃 森 生 物	2022-04 -14	145.80	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202204280000 1139	阳 光 电 源	2022-04 -28	3,236,976. 00	53,100.0 0	28	1.90	4,783.5 3	-	-
中 信 证 券	202204280000 1145	蓝 思 科 技	2022-04 -28	6,249,200. 00	680,000. 00	28	1.90	9,234.9 3	-	-
中 信 证 券	202204280000 7598	深 信 服	2022-04 -28	508,680.00	6,000.00	14	2.30	454.99	-	-
中 信 证 券	202204280000 7600	康 泰 生 物	2022-04 -28	184,950.00	3,000.00	14	3.00	215.78	-	-
中 信 证 券	202204280000 8614	康 泰 生 物	2022-04 -28	86,310.00	1,400.00	14	1.80	60.42	-	-
中	202204280000	时	2022-04	45,490.00	1,000.00	28	1.80	63.69	-	-

信 证 券	8704	代 电 气	-28							
中 信 证 券	202204280000 8710	迈 瑞 医 疗	2022-04 -28	797,500.00	2,500.00	28	1.80	1,116.5 0	-	-
中 信 证 券	202204280000 8712	康 龙 化 成	2022-04 -28	166,517.00	1,300.00	28	1.80	233.12	-	-
中 信 证 券	202204280000 8716	卓 胜 微	2022-04 -28	219,960.00	1,200.00	28	1.80	307.94	-	-
中 信 证 券	202204280000 8948	智 飞 生 物	2022-04 -28	365,508.00	3,900.00	28	1.80	511.71	-	-
中 信 证 券	202204280000 8960	欣 旺 达	2022-04 -28	123,782.00	5,900.00	28	1.80	173.29	-	-
中 信 证 券	202204280000 8968	康 泰 生 物	2022-04 -28	123,300.00	2,000.00	28	1.80	172.62	-	-
中 信 证 券	202204280000 8972	贝 达 药 业	2022-04 -28	48,708.00	1,200.00	28	1.80	68.19	-	-
中 信 证 券	202204280000 8978	亿 联 网 络	2022-04 -28	134,442.00	1,800.00	28	1.80	188.22	-	-
中 信 证 券	202204280000 8984	泰 格 医 药	2022-04 -28	224,510.00	2,600.00	28	1.80	314.31	-	-
中 信 证 券	202204280000 8988	深 信 服	2022-04 -28	84,780.00	1,000.00	28	1.80	118.69	-	-
中	202204280000	珠	2022-04	60,960.00	3,000.00	14	1.80	42.67	-	-

信 证 券	9000	海 冠 宇	-28							
中 信 证 券	202204280000 9002	沃 森 生 物	2022-04 -28	269,082.00	5,400.00	14	1.80	188.36	-	-
中 信 证 券	202204280000 9004	阳 光 电 源	2022-04 -28	207,264.00	3,400.00	14	1.80	145.08	-	-
中 信 证 券	202204280000 9006	北 京 君 正	2022-04 -28	73,180.00	1,000.00	14	1.80	51.23	-	-
中 信 证 券	202204280000 9008	汇 川 技 术	2022-04 -28	296,376.00	5,300.00	14	1.80	207.46	-	-
中 信 证 券	202204280000 9010	泰 格 医 药	2022-04 -28	155,430.00	1,800.00	14	1.80	108.80	-	-
中 信 证 券	202204280000 9012	传 音 控 股	2022-04 -28	95,412.00	1,200.00	14	1.80	66.79	-	-
中 信 证 券	202204280000 9014	先 导 智 能	2022-04 -28	135,168.00	3,200.00	14	1.80	94.62	-	-
中 信 证 券	202204280000 9016	华 润 微	2022-04 -28	60,216.00	1,300.00	14	1.80	42.15	-	-
中 信 证 券	202204280000 9018	康 龙 化 成	2022-04 -28	128,090.00	1,000.00	14	1.80	89.66	-	-
中 信 证 券	202204280000 9020	君 实 生 物	2022-04 -28	95,150.00	1,000.00	14	1.80	66.61	-	-
中	202204280000	卓	2022-04	183,300.00	1,000.00	14	1.80	128.31	-	-

信 证 券	9022	胜 微	-28								
中 信 证 券	202204280000 9024	澜 起 科 技	2022-04 -28	126,808.00	2,200.00	14	1.80	88.77	-	-	
中 信 证 券	202204280000 9026	乐 普 医 疗	2022-04 -28	69,058.00	4,300.00	14	1.80	48.34	-	-	
中 信 证 券	202204280000 9028	华 大 基 因	2022-04 -28	61,000.00	1,000.00	14	1.80	42.70	-	-	
中 信 证 券	202204280000 9030	迈 瑞 医 疗	2022-04 -28	638,000.00	2,000.00	14	1.80	446.60	-	-	
中 信 证 券	202204280000 9032	蓝 思 科 技	2022-04 -28	46,869.00	5,100.00	14	1.80	32.81	-	-	
中 信 证 券	202204280000 9034	金 山 办 公	2022-04 -28	158,990.00	1,000.00	14	1.80	111.29	-	-	
中 信 证 券	202204280000 9036	时 代 电 气	2022-04 -28	136,470.00	3,000.00	14	1.80	95.53	-	-	
中 信 证 券	202204280000 9038	中 芯 国 际	2022-04 -28	208,505.00	5,500.00	14	1.80	145.95	-	-	
中 信 证 券	202204280000 9040	亿 纬 锂 能	2022-04 -28	238,830.00	3,800.00	14	1.80	167.18	-	-	
中 信 证 券	202204280000 9042	深 信 服	2022-04 -28	84,780.00	1,000.00	14	1.80	59.35	-	-	
中	202204280000	中	2022-04	52,750.00	12,500.0	14	1.80	36.93	-	-	

信 证 券	9044	国 通 号	-28		0					
中 信 证 券	202204280000 9046	亿 联 网 络	2022-04 -28	74,690.00	1,000.00	14	1.80	52.28	-	-
中 信 证 券	202204280000 9048	中 科 创 达	2022-04 -28	82,800.00	1,000.00	14	1.80	57.96	-	-
中 信 证 券	202204280000 9050	中 微 公 司	2022-04 -28	130,013.00	1,300.00	14	1.80	91.01	-	-
中 信 证 券	202204280000 9052	沪 硅 产 业	2022-04 -28	48,192.00	2,400.00	14	1.80	33.73	-	-
中 信 证 券	202204280000 9054	三 环 集 团	2022-04 -28	91,205.00	3,700.00	14	1.80	63.84	-	-
中 信 证 券	202204280000 9056	贝 达 药 业	2022-04 -28	40,590.00	1,000.00	14	1.80	28.41	-	-
中 信 证 券	202204280000 9058	智 飞 生 物	2022-04 -28	234,300.00	2,500.00	14	1.80	164.01	-	-
中 信 证 券	202205050005 9443	先 导 智 能	2022-05 -05	254,676.00	5,700.00	14	1.90	188.18	-	-
中 信 证 券	202205050005 9445	宁 德 时 代	2022-05 -05	789,600.00	2,100.00	14	1.90	583.43	-	-
中 信 证 券	202205050005 9451	泰 格 医 药	2022-05 -05	2,875,311. 00	32,700.0 0	14	1.80	2,012.7 2	-	-
中	202205050005	亿	2022-05	454,572.00	6,900.00	14	1.90	335.88	-	-

信 证 券	9455	纬 锂 能	-05							
中 信 证 券	202205050005 9457	汇 川 技 术	2022-05 -05	542,469.00	9,300.00	14	1.90	400.82	-	-
中 信 证 券	202205050005 9465	中 伟 股 份	2022-05 -05	822,000.00	10,000.0 0	14	1.80	575.40	-	-
中 信 证 券	202205050007 2241	亿 纬 锂 能	2022-05 -05	329,400.00	5,000.00	14	2.30	294.63	-	-
中 信 证 券	202205050007 2363	深 信 服	2022-05 -05	922,000.00	10,000.0 0	14	2.00	717.11	-	-
中 信 证 券	202205050007 3035	华 大 基 因	2022-05 -05	2,193,680. 00	34,000.0 0	14	3.10	2,644.6 0	-	-
中 信 证 券	202205050007 3037	华 大 基 因	2022-05 -05	1,290,400. 00	20,000.0 0	14	3.10	1,555.6 5	-	-
中 信 证 券	202205060001 4633	和 辉 光 电	2022-05 -06	24,500.00	10,000.0 0	14	1.80	17.15	-	-
中 信 证 券	202205060001 4641	欣 旺 达	2022-05 -06	92,742.00	4,100.00	14	1.80	64.92	-	-
中 信 证 券	202205100000 1017	北 京 君 正	2022-05 -10	2,073,068. 00	27,700.0 0	14	3.50	2,821.6 8	-	-
中 信 证 券	202205100000 1018	沃 森 生 物	2022-05 -10	2,542,675. 00	50,500.0 0	14	3.10	3,065.3 4	-	-
中	202205110000	迈	2022-05	2,298,750.	7,500.00	14	1.30	1,162.1	-	-

信 证 券	0679	瑞 医 疗	-11	00				5		
中 信 证 券	202205110000 0690	欣 旺 达	2022-05 -11	154,860.00	6,000.00	14	3.50	210.78	-	-
中 信 证 券	202205120000 0907	智 飞 生 物	2022-05 -12	1,990,576. 00	19,600.0 0	14	2.30	1,780.4 6	-	-
中 信 证 券	202205120000 7360	亿 联 网 络	2022-05 -12	72,340.00	1,000.00	14	1.80	50.64	-	-
中 信 证 券	202205120000 7362	贝 达 药 业	2022-05 -12	45,170.00	1,000.00	14	1.80	31.62	-	-
中 信 证 券	202205120000 7364	华 大 基 因	2022-05 -12	67,200.00	1,000.00	14	1.80	47.04	-	-
中 信 证 券	202205120000 7366	康 泰 生 物	2022-05 -12	96,572.00	1,400.00	14	1.80	67.60	-	-
中 信 证 券	202205120000 7368	康 龙 化 成	2022-05 -12	115,240.00	1,000.00	14	1.80	80.67	-	-
中 信 证 券	202205120000 7370	迈 瑞 医 疗	2022-05 -12	611,420.00	2,000.00	14	1.80	427.99	-	-
中 信 证 券	202205120000 7372	中 微 公 司	2022-05 -12	142,207.00	1,300.00	14	1.80	99.54	-	-
中 信 证 券	202205120000 7374	中 科 创 达	2022-05 -12	102,200.00	1,000.00	14	1.80	71.54	-	-
中	202205120000	传	2022-05	100,044.00	1,200.00	14	1.80	70.03	-	-

信 证 券	7376	音 控 股	-12							
中 信 证 券	202205120000 7378	金 山 办 公	2022-05 -12	204,350.00	1,000.00	14	1.80	143.05	-	-
中 信 证 券	202205120000 7380	卓 胜 微	2022-05 -12	195,500.00	1,000.00	14	1.80	136.85	-	-
中 信 证 券	202205120000 7382	澜 起 科 技	2022-05 -12	143,440.00	2,200.00	14	1.80	100.41	-	-
中 信 证 券	202205120000 7384	亿 纬 锂 能	2022-05 -12	280,174.00	3,800.00	14	1.80	196.12	-	-
中 信 证 券	202205120000 7386	中 国 通 号	2022-05 -12	54,875.00	12,500.0 0	14	1.80	38.41	-	-
中 信 证 券	202205120000 7388	智 飞 生 物	2022-05 -12	253,900.00	2,500.00	14	1.80	177.73	-	-
中 信 证 券	202205120000 7390	深 信 服	2022-05 -12	89,400.00	1,000.00	14	1.80	62.58	-	-
中 信 证 券	202205120000 7392	汇 川 技 术	2022-05 -12	297,012.00	5,300.00	14	1.80	207.91	-	-
中 信 证 券	202205120000 7394	乐 普 医 疗	2022-05 -12	79,550.00	4,300.00	14	1.80	55.69	-	-
中 信 证 券	202205120000 7396	沃 森 生 物	2022-05 -12	281,286.00	5,400.00	14	1.80	196.90	-	-
中	202205120000	三	2022-05	105,857.00	3,700.00	14	1.80	74.10	-	-

信 证 券	7398	环 集 团	-12							
中 信 证 券	202205120000 7400	蓝 思 科 技	2022-05 -12	50,541.00	5,100.00	14	1.80	35.38	-	-
中 信 证 券	202205120000 7402	先 导 智 能	2022-05 -12	147,200.00	3,200.00	14	1.80	103.04	-	-
中 信 证 券	202205120000 7404	阳 光 电 源	2022-05 -12	244,256.00	3,400.00	14	1.80	170.98	-	-
中 信 证 券	202205120000 7406	北 京 君 正	2022-05 -12	78,380.00	1,000.00	14	1.80	54.87	-	-
中 信 证 券	202205120000 7408	沪 硅 产 业	2022-05 -12	54,120.00	2,400.00	14	1.80	37.88	-	-
中 信 证 券	202205120000 7410	泰 格 医 药	2022-05 -12	155,988.00	1,800.00	14	1.80	109.19	-	-
中 信 证 券	202205120000 7412	时 代 电 气	2022-05 -12	153,540.00	3,000.00	14	1.80	107.48	-	-
中 信 证 券	202205120000 7414	华 润 微	2022-05 -12	65,494.00	1,300.00	14	1.80	45.85	-	-
中 信 证 券	202205120000 7416	珠 海 冠 宇	2022-05 -12	75,000.00	3,000.00	14	1.80	52.50	-	-
中 信 证 券	202205120000 7418	中 芯 国 际	2022-05 -12	238,260.00	5,500.00	14	1.80	166.78	-	-
中	202205120000	君	2022-05	125,700.00	1,000.00	14	1.80	87.99	-	-

信 证 券	7420	实 生 物	-12								
中 信 证 券	202205120000 8944	康 泰 生 物	2022-05 -12	206,940.00	3,000.00	14	2.40	193.14	-	-	
中 信 证 券	202205120000 9952	深 信 服	2022-05 -12	536,400.00	6,000.00	14	2.90	604.94	-	-	
中 信 证 券	202205170000 0844	蓝 思 科 技	2022-05 -17	983,839.00	100,700. 00	14	1.80	688.69	-	-	
中 信 证 券	202205170000 0846	泰 格 医 药	2022-05 -17	2,851,440. 00	32,700.0 0	14	1.80	1,996.0 1	-	-	
中 信 证 券	202205170000 0852	三 环 集 团	2022-05 -17	1,596,522. 00	52,900.0 0	14	1.80	1,117.5 7	-	-	
中 信 证 券	202205170000 0853	迈 瑞 医 疗	2022-05 -17	3,300,520. 00	10,900.0 0	14	1.80	2,310.3 6	-	-	
中 信 证 券	202205170000 0857	沃 森 生 物	2022-05 -17	3,469,452. 00	72,100.0 0	14	1.80	2,428.6 2	-	-	
中 信 证 券	202205170000 0860	智 飞 生 物	2022-05 -17	3,013,590. 00	32,300.0 0	14	1.80	2,109.5 1	-	-	
中 信 证 券	202205180000 0866	华 大 基 因	2022-05 -18	1,492,164. 00	22,900.0 0	14	3.30	1,914.9 4	-	-	
中 信 证 券	202205180000 4815	迈 瑞 医 疗	2022-04 -28	8,750.00	-	28	1.80	-	-	-	
中	202205180000	迈	2022-05	26,250.00	-	14	1.30	-	-	-	

信 证 券	5026	瑞 医 疗	-11							
中 信 证 券	202205180000 5059	迈 瑞 医 疗	2022-05 -12	7,000.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205180000 5120	迈 瑞 医 疗	2022-05 -17	38,150.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205190000 0553	欣 旺 达	2022-05 -19	1,997,517. 00	73,900.0 0	14	3.40	2,641.1 6	-	-
中 信 证 券	202205190000 0575	康 泰 生 物	2022-05 -19	2,025,150. 00	34,500.0 0	14	3.30	2,598.9 4	-	-
中 信 证 券	202205190003 8809	华 大 基 因	2022-05 -19	1,297,400. 00	20,000.0 0	14	3.60	1,816.3 6	-	-
中 信 证 券	202205190003 8819	华 大 基 因	2022-05 -19	2,205,580. 00	34,000.0 0	14	3.60	3,087.8 1	-	-
中 信 证 券	202205190003 8887	沃 森 生 物	2022-05 -19	47,080.00	1,000.00	28	3.00	109.85	-	-
中 信 证 券	202205190004 1375	三 环 集 团	2022-05 -19	30,370.00	1,000.00	28	2.80	66.14	-	-
中 信 证 券	202205190004 3101	亿 纬 锂 能	2022-05 -19	549,930.00	6,900.00	14	1.90	406.34	-	-
中 信 证 券	202205190004 3103	中 伟 股 份	2022-05 -19	1,068,300. 00	10,000.0 0	14	1.80	747.81	-	-
中	202205190004	先	2022-05	279,414.00	5,700.00	14	1.90	206.46	-	-

信证 券	3119	导 智 能	-19								
中 信 证 券	202205190004 3127	宁 德 时 代	2022-05 -19	879,900.00	2,100.00	14	1.90	650.15	-	-	
中 信 证 券	202205190004 3129	汇 川 技 术	2022-05 -19	554,280.00	9,300.00	14	1.90	409.55	-	-	
中 信 证 券	202205190005 1147	亿 纬 锂 能	2022-05 -19	398,500.00	5,000.00	14	3.40	526.91	-	-	
中 信 证 券	202205200001 3636	和 辉 光 电	2022-05 -20	25,000.00	10,000.0 0	14	1.80	21.25	-	-	
中 信 证 券	202205200001 5872	欣 旺 达	2022-05 -20	113,529.00	4,100.00	14	1.80	96.50	-	-	
中 信 证 券	202205240000 1018	迈 为 股 份	2022-05 -24	1,939,747. 00	5,300.00	14	2.90	2,187.6 0	-	-	
中 信 证 券	202205240000 8446	沃 森 生 物	2022-05 -24	2,413,395. 00	50,500.0 0	14	3.20	3,003.3 4	-	-	
中 信 证 券	202205240000 8448	北 京 君 正	2022-05 -24	2,532,611. 00	27,700.0 0	14	3.40	3,348.6 7	-	-	
中 信 证 券	202205250000 0742	欣 旺 达	2022-05 -25	1,967,725. 00	77,500.0 0	14	3.30	2,525.2 5	-	-	
中 信 证 券	202205250000 7223	欣 旺 达	2022-05 -25	152,340.00	6,000.00	14	3.40	201.43	-	-	
中	202205250001	金	2022-05	700.00	-	14	1.80	-	-	-	

信 证 券	1483	山 办 公	-12								
中 信 证 券	202205260000 0798	先 导 智 能	2022-05 -26	45,660.00	1,000.00	14	2.90	51.49	-	-	
中 信 证 券	202205260000 0809	迈 为 股 份	2022-05 -26	369,000.00	1,000.00	14	2.90	416.15	-	-	
中 信 证 券	202205260000 6912	欣 旺 达	2022-05 -26	152,987.00	5,900.00	14	1.80	107.09	-	-	
中 信 证 券	202205260000 7268	康 泰 生 物	2022-05 -26	182,430.00	3,000.00	14	3.30	234.12	-	-	
中 信 证 券	202205260000 7270	深 信 服	2022-05 -26	509,460.00	6,000.00	14	3.40	673.62	-	-	
中 信 证 券	202205260000 9230	亿 纬 锂 能	2022-05 -26	290,548.00	3,800.00	14	1.80	203.38	-	-	
中 信 证 券	202205260000 9232	乐 普 医 疗	2022-05 -26	76,755.00	4,300.00	14	1.80	53.73	-	-	
中 信 证 券	202205260000 9234	智 飞 生 物	2022-05 -26	216,000.00	2,500.00	14	1.80	151.20	-	-	
中 信 证 券	202205260000 9236	中 微 公 司	2022-05 -26	140,400.00	1,300.00	14	1.80	98.28	-	-	
中 信 证 券	202205260000 9238	传 音 控 股	2022-05 -26	101,484.00	1,200.00	14	1.80	71.04	-	-	
中	202205260000	中	2022-05	55,250.00	12,500.0	14	1.80	38.68	-	-	

信 证 券	9240	国 通 号	-26		0					
中 信 证 券	202205260000 9242	金 山 办 公	2022-05 -26	200,200.00	1,000.00	14	1.80	140.14	-	-
中 信 证 券	202205260000 9244	迈 瑞 医 疗	2022-05 -26	566,600.00	2,000.00	14	1.80	396.62	-	-
中 信 证 券	202205260000 9246	卓 胜 微	2022-05 -26	186,680.00	1,000.00	14	1.80	130.68	-	-
中 信 证 券	202205260000 9248	澜 起 科 技	2022-05 -26	134,178.00	2,200.00	14	1.80	93.92	-	-
中 信 证 券	202205260000 9250	中 芯 国 际	2022-05 -26	233,310.00	5,500.00	14	1.80	163.32	-	-
中 信 证 券	202205260000 9252	华 润 微	2022-05 -26	65,091.00	1,300.00	14	1.80	45.56	-	-
中 信 证 券	202205260000 9254	珠 海 冠 宇	2022-05 -26	78,630.00	3,000.00	14	1.80	55.04	-	-
中 信 证 券	202205260001 0528	卓 胜 微	2022-05 -26	224,016.00	1,200.00	14	1.80	156.81	-	-
中 信 证 券	202205260001 0544	泰 格 医 药	2022-05 -26	206,180.00	2,600.00	14	1.80	144.33	-	-
中 信 证 券	202205260001 0546	贝 达 药 业	2022-05 -26	53,928.00	1,200.00	14	1.80	37.75	-	-
中	202205260001	深	2022-05	84,910.00	1,000.00	14	1.80	59.44	-	-

信 证 券	0550	信 服	-26								
中 信 证 券	202205260001 0554	亿 联 网 络	2022-05 -26	130,680.00	1,800.00	14	1.80	91.48	-	-	
中 信 证 券	202205260001 0556	时 代 电 气	2022-05 -26	54,180.00	1,000.00	14	1.80	37.93	-	-	
中 信 证 券	202205260001 0562	智 飞 生 物	2022-05 -26	336,960.00	3,900.00	14	1.80	235.87	-	-	
中 信 证 券	202205260001 0572	康 龙 化 成	2022-05 -26	137,956.00	1,300.00	14	1.80	96.57	-	-	
中 信 证 券	202205260001 1512	康 泰 生 物	2022-05 -26	121,620.00	2,000.00	14	1.80	85.13	-	-	
中 信 证 券	202205260001 1518	阳 光 电 源	2022-05 -26	4,168,350. 00	53,100.0 0	14	1.90	3,079.9 5	-	-	
中 信 证 券	202205260001 1526	迈 瑞 医 疗	2022-05 -26	708,250.00	2,500.00	14	1.80	495.78	-	-	
中 信 证 券	202205260001 2272	沪 硅 产 业	2022-05 -26	53,832.00	2,400.00	14	1.80	37.68	-	-	
中 信 证 券	202205260001 2274	时 代 电 气	2022-05 -26	162,540.00	3,000.00	14	1.80	113.78	-	-	
中 信 证 券	202205260001 2276	康 龙 化 成	2022-05 -26	106,120.00	1,000.00	14	1.80	74.28	-	-	
中	202205260001	君	2022-05	88,880.00	1,000.00	14	1.80	62.22	-	-	

信 证 券	2278	实 生 物	-26							
中 信 证 券	202205260001 2280	泰 格 医 药	2022-05 -26	142,740.00	1,800.00	14	1.80	99.92	-	-
中 信 证 券	202205260001 2282	三 环 集 团	2022-05 -26	108,595.00	3,700.00	14	1.80	76.02	-	-
中 信 证 券	202205260001 2284	汇 川 技 术	2022-05 -26	313,177.00	5,300.00	14	1.80	219.22	-	-
中 信 证 券	202205260001 2286	蓝 思 科 技	2022-05 -26	51,102.00	5,100.00	14	1.80	35.77	-	-
中 信 证 券	202205260001 2288	沃 森 生 物	2022-05 -26	257,796.00	5,400.00	14	1.80	180.46	-	-
中 信 证 券	202205260001 2290	北 京 君 正	2022-05 -26	88,460.00	1,000.00	14	1.80	61.92	-	-
中 信 证 券	202205260001 2292	阳 光 电 源	2022-05 -26	266,900.00	3,400.00	14	1.80	186.83	-	-
中 信 证 券	202205260001 2294	华 大 基 因	2022-05 -26	66,290.00	1,000.00	14	1.80	46.40	-	-
中 信 证 券	202205260001 2296	康 泰 生 物	2022-05 -26	85,134.00	1,400.00	14	1.80	59.59	-	-
中 信 证 券	202205260001 2298	贝 达 药 业	2022-05 -26	44,940.00	1,000.00	14	1.80	31.46	-	-
中	202205260001	先	2022-05	146,112.00	3,200.00	14	1.80	102.28	-	-

信 证 券	2300	导 智 能	-26							
中 信 证 券	202205260001 2302	亿 联 网 络	2022-05 -26	72,600.00	1,000.00	14	1.80	50.82	-	-
中 信 证 券	202205260001 2304	深 信 服	2022-05 -26	84,910.00	1,000.00	14	1.80	59.44	-	-
中 信 证 券	202205260001 2306	中 科 创 达	2022-05 -26	104,200.00	1,000.00	14	1.80	72.94	-	-
中 信 证 券	202205260001 2668	中 伟 股 份	2022-05 -19	1,668.99	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205260001 6486	珠 海 冠 宇	2022-05 -26	540.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205270000 7530	贝 达 药 业	2022-05 -26	300.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205270000 7536	贝 达 药 业	2022-05 -26	250.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205300000 5593	泰 格 医 药	2022-05 -17	16,350.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205300000 5784	泰 格 医 药	2022-05 -26	1,300.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205300000 5800	泰 格 医 药	2022-05 -26	900.00	-	14	1.80	-	-	-
中	202205300000	亿	2022-05	1,440.00	-	14	1.80	-	-	-

信 证 券	6004	联 网 络	-26							
中 信 证 券	202205300000 6016	亿 联 网 络	2022-05 -26	800.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205310000 1367	蓝 思 科 技	2022-05 -31	2,795,750. 00	265,000. 00	14	2.40	2,609.3 7	-	-
中 信 证 券	202205310000 1372	亿 联 网 络	2022-05 -31	73,940.00	1,000.00	14	3.30	94.89	-	-
中 信 证 券	202205310000 1392	迈 瑞 医 疗	2022-05 -31	605,000.00	2,000.00	14	2.40	564.67	-	-
中 信 证 券	202205310000 1404	乐 普 医 疗	2022-05 -31	194,590.00	11,000.0 0	14	3.00	227.02	-	-
中 信 证 券	202205310000 8785	蓝 思 科 技	2022-05 -31	1,062,385. 00	100,700. 00	14	1.80	743.67	-	-
中 信 证 券	202205310000 9203	智 飞 生 物	2022-05 -31	2,819,144. 00	32,300.0 0	14	1.80	1,973.4 0	-	-
中 信 证 券	202205310000 9213	泰 格 医 药	2022-05 -31	2,809,584. 00	32,700.0 0	14	1.80	1,966.7 1	-	-
中 信 证 券	202205310000 9215	三 环 集 团	2022-05 -31	1,566,898. 00	52,900.0 0	14	1.80	1,096.8 3	-	-
中 信 证 券	202205310000 9217	沃 森 生 物	2022-05 -31	3,347,603. 00	72,100.0 0	14	1.80	2,343.3 2	-	-
中	202205310000	迈	2022-05	3,297,250.	10,900.0	14	1.80	2,308.0	-	-

信 证 券	9219	瑞 医 疗	-31	00	0			8		
中 信 证 券	202205310001 0599	蓝 思 科 技	2022-05 -26	510.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205310001 0644	蓝 思 科 技	2022-05 -31	26,500.00	-	14	2.40	-	-	-
中 信 证 券	202205310001 0661	蓝 思 科 技	2022-05 -31	10,070.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 1146	中 科 创 达	2022-06 -01	2,193,638. 00	19,300.0 0	14	4.10	3,497.6 3	-	-
中 信 证 券	202206010000 1149	迈 瑞 医 疗	2022-06 -01	3,338,830. 00	11,000.0 0	14	2.40	3,116.2 4	-	-
中 信 证 券	202206010000 1153	蓝 思 科 技	2022-06 -01	3,107,950. 00	305,000. 00	14	2.40	2,900.7 5	-	-
中 信 证 券	202206010000 1476	中 科 创 达	2022-06 -01	1,193,430. 00	10,500.0 0	14	1.80	835.40	-	-
中 信 证 券	202206010000 4504	华 大 基 因	2022-06 -01	1,498,805. 00	22,900.0 0	14	4.00	2,331.4 7	-	-
中 信 证 券	202206010000 6503	康 泰 生 物	2022-05 -19	29,325.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 6676	康 泰 生 物	2022-05 -26	2,550.00	-	14	3.30	-	-	-
中	202206010000	康	2022-05	1,700.00	-	14	1.80	-	-	-

信 证 券	6706	泰 生 物	-26							
中 信 证 券	202206010000 6716	康 泰 生 物	2022-05 -26	1,190.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 6873	康 泰 生 物	2022-05 -19	-	20,700.0 0	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 7046	康 泰 生 物	2022-05 -26	-	1,800.00	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 7076	康 泰 生 物	2022-05 -26	-	1,200.00	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 7086	康 泰 生 物	2022-05 -26	-	840.00	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206020000 1028	康 泰 生 物	2022-06 -02	901,440.00	24,000.0 0	14	3.20	1,121.7 9	-	-
中 信 证 券	202206020001 3626	亿 纬 锂 能	2022-06 -02	432,300.00	5,000.00	14	2.80	470.73	-	-
中 信 证 券	202206020001 3634	华 大 基 因	2022-06 -02	2,233,120. 00	34,000.0 0	14	3.40	2,952.6 8	-	-
中 信 证 券	202206020001 3636	华 大 基 因	2022-06 -02	1,313,600. 00	20,000.0 0	14	3.40	1,736.8 7	-	-
中 信 证 券	202206020001 7734	欣 旺 达	2022-06 -02	2,126,103. 00	73,900.0 0	14	3.60	2,976.5 4	-	-
中	202206020001	康	2022-06	1,295,820.	34,500.0	14	3.20	1,612.5	-	-

信 证 券	7736	泰 生 物	-02	00	0			8		
中 信 证 券	202206020002 0158	中 伟 股 份	2022-06 -02	1,090,000. 00	10,000.0 0	14	1.80	763.00	-	-
中 信 证 券	202206060000 9890	和 辉 光 电	2022-06 -06	28,300.00	10,000.0 0	14	1.80	19.81	-	-
中 信 证 券	202206060000 9892	欣 旺 达	2022-06 -06	128,330.00	4,100.00	14	1.80	89.83	-	-
中 信 证 券	202206070000 7980	沃 森 生 物	2022-06 -07	2,344,210. 00	50,500.0 0	14	2.90	2,643.7 5	-	-
中 信 证 券	202206070000 8126	北 京 君 正	2022-06 -07	2,591,335. 00	27,700.0 0	14	3.30	3,325.5 5	-	-
中 信 证 券	202206070000 8228	迈 为 股 份	2022-06 -07	2,098,376. 00	5,300.00	14	3.40	2,774.5 2	-	-
中 信 证 券	202206080000 1138	蓝 思 科 技	2022-06 -08	102,663.00	9,900.00	14	2.10	83.84	-	-
中 信 证 券	202206080000 6647	欣 旺 达	2022-06 -08	2,394,750. 00	77,500.0 0	14	3.60	3,352.6 5	-	-
中 信 证 券	202206080000 6655	欣 旺 达	2022-06 -08	185,400.00	6,000.00	14	3.60	259.56	-	-
中 信 证 券	202206090000 0860	深 信 服	2022-06 -09	100,760.00	1,000.00	14	3.40	133.23	-	-
中	202206090000	华	2022-06	75,777.00	1,300.00	14	1.80	53.04	-	-

信 证 券	6929	润 微	-09							
中 信 证 券	202206090000 6933	时 代 电 气	2022-06 -09	58,090.00	1,000.00	14	1.80	40.66	-	-
中 信 证 券	202206090000 6941	迈 瑞 医 疗	2022-06 -09	609,520.00	2,000.00	14	1.80	426.66	-	-
中 信 证 券	202206090000 6943	时 代 电 气	2022-06 -09	174,270.00	3,000.00	14	1.80	121.99	-	-
中 信 证 券	202206090000 6945	康 龙 化 成	2022-06 -09	132,840.00	1,000.00	14	1.80	92.99	-	-
中 信 证 券	202206090000 6949	迈 瑞 医 疗	2022-06 -09	761,900.00	2,500.00	14	1.80	533.33	-	-
中 信 证 券	202206090000 6951	卓 胜 微	2022-06 -09	198,090.00	1,000.00	14	1.80	138.66	-	-
中 信 证 券	202206090000 6953	传 音 控 股	2022-06 -09	120,204.00	1,200.00	14	1.80	84.14	-	-
中 信 证 券	202206090000 6955	康 龙 化 成	2022-06 -09	172,692.00	1,300.00	14	1.80	120.88	-	-
中 信 证 券	202206090000 6959	华 大 基 因	2022-06 -09	65,500.00	1,000.00	14	1.80	45.85	-	-
中 信 证 券	202206090000 6965	卓 胜 微	2022-06 -09	237,708.00	1,200.00	14	1.80	166.40	-	-
中	202206090000	中	2022-06	57,000.00	12,500.0	14	1.80	39.90	-	-

信 证 券	6971	国 通 号	-09		0					
中 信 证 券	202206090000 6975	中 微 公 司	2022-06 -09	159,419.00	1,300.00	14	1.80	111.59	-	-
中 信 证 券	202206090000 6983	澜 起 科 技	2022-06 -09	151,096.00	2,200.00	14	1.80	105.77	-	-
中 信 证 券	202206090000 6985	珠 海 冠 宇	2022-06 -09	89,940.00	3,000.00	14	1.80	62.96	-	-
中 信 证 券	202206090000 6991	中 芯 国 际	2022-06 -09	241,505.00	5,500.00	14	1.80	169.05	-	-
中 信 证 券	202206090000 6993	亿 联 网 络	2022-06 -09	139,752.00	1,800.00	14	1.80	97.83	-	-
中 信 证 券	202206090000 6997	三 环 集 团	2022-06 -09	108,706.00	3,700.00	14	1.80	76.09	-	-
中 信 证 券	202206090000 6999	蓝 思 科 技	2022-06 -09	51,306.00	5,100.00	14	1.80	35.91	-	-
中 信 证 券	202206090000 7003	泰 格 医 药	2022-06 -09	248,820.00	2,600.00	14	1.80	174.17	-	-
中 信 证 券	202206090000 7005	泰 格 医 药	2022-06 -09	172,260.00	1,800.00	14	1.80	120.58	-	-
中 信 证 券	202206090000 7009	阳 光 电 源	2022-06 -09	4,872,456. 00	53,100.0 0	14	1.90	3,600.2 0	-	-
中	202206090000	阳	2022-06	311,984.00	3,400.00	14	1.80	218.39	-	-

信 证 券	7011	光 电 源	-09							
中 信 证 券	202206090000 7013	亿 联 网 络	2022-06 -09	77,640.00	1,000.00	14	1.80	54.35	-	-
中 信 证 券	202206090000 7017	康 泰 生 物	2022-06 -09	77,920.00	2,000.00	14	1.80	54.54	-	-
中 信 证 券	202206090000 7019	先 导 智 能	2022-06 -09	173,088.00	3,200.00	14	1.80	121.16	-	-
中 信 证 券	202206090000 7023	中 科 创 达	2022-06 -09	115,100.00	1,000.00	14	1.80	80.57	-	-
中 信 证 券	202206090000 7025	康 泰 生 物	2022-06 -09	54,544.00	1,400.00	14	1.80	38.18	-	-
中 信 证 券	202206090000 7027	深 信 服	2022-06 -09	100,760.00	1,000.00	14	1.80	70.53	-	-
中 信 证 券	202206090000 7033	深 信 服	2022-06 -09	100,760.00	1,000.00	14	1.80	70.53	-	-
中 信 证 券	202206090000 7039	亿 纬 锂 能	2022-06 -09	347,358.00	3,800.00	14	1.80	243.15	-	-
中 信 证 券	202206090000 7043	乐 普 医 疗	2022-06 -09	74,046.00	4,300.00	14	1.80	51.83	-	-
中 信 证 券	202206090000 7049	欣 旺 达	2022-06 -09	174,935.00	5,900.00	14	1.80	122.45	-	-
中	202206090000	北	2022-06	89,900.00	1,000.00	14	1.80	62.93	-	-

信 证 券	7051	京 君 正	-09							
中 信 证 券	202206090000 7057	沃 森 生 物	2022-06 -09	243,540.00	5,400.00	14	1.80	170.48	-	-
中 信 证 券	202206090000 7059	智 飞 生 物	2022-06 -09	220,125.00	2,500.00	14	1.80	154.09	-	-
中 信 证 券	202206090000 7061	智 飞 生 物	2022-06 -09	343,395.00	3,900.00	14	1.80	240.38	-	-
中 信 证 券	202206090000 7065	汇 川 技 术	2022-06 -09	341,903.00	5,300.00	14	1.80	239.33	-	-
中 信 证 券	202206090000 7073	先 导 智 能	2022-06 -09	54,090.00	1,000.00	14	2.10	44.17	-	-
中 信 证 券	202206090000 7075	深 信 服	2022-06 -09	604,560.00	6,000.00	14	3.40	799.36	-	-
中 信 证 券	202206090000 7077	康 泰 生 物	2022-06 -09	116,880.00	3,000.00	14	3.20	145.45	-	-
中 信 证 券	202206090001 0995	沪 硅 产 业	2022-06 -09	58,200.00	2,400.00	14	1.80	40.74	-	-
中 信 证 券	202206090001 0999	君 实 生 物	2022-06 -09	85,080.00	1,000.00	14	1.80	59.56	-	-
中 信 证 券	202206090001 1003	金 山 办 公	2022-06 -09	209,170.00	1,000.00	14	1.80	146.42	-	-
中	202206090001	迈	2022-06	391,910.00	1,000.00	14	3.40	518.19	-	-

信 证 券	1157	为 股 份	-09							
中 信 证 券	202206090001 1465	三 环 集 团	2022-05 -19	320.00	-	28	2.80	-	-	-
中 信 证 券	202206090001 1501	三 环 集 团	2022-05 -31	16,928.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206090001 1679	三 环 集 团	2022-06 -09	1,184.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206130002 2296	深 信 服	2022-06 -09	70.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202206130002 2311	深 信 服	2022-06 -09	70.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206130002 2313	深 信 服	2022-06 -09	70.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206130002 2315	深 信 服	2022-06 -09	420.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202206130002 2881	康 龙 化 成	2022-06 -09	450.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206130002 2883	康 龙 化 成	2022-06 -09	585.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206130002 3205	康 龙 化 成	2022-06 -09	-	500.00	14	1.80	-	-	-
中	202206130002	康	2022-06	-	650.00	14	1.80	-	-	-

信 证 券	3207	龙 化 成	-09							
中 信 证 券	202206140000 1411	先 导 智 能	2022-06 -14	3,771,903. 00	59,900.0 0	14	1.90	2,787.0 2	-	-
中 信 证 券	202206140000 1412	智 飞 生 物	2022-06 -14	2,714,678. 00	30,200.0 0	14	1.90	2,005.8 5	-	-
中 信 证 券	202206140000 1413	圣 邦 股 份	2022-06 -14	681,800.00	2,800.00	14	1.90	503.77	-	-
中 信 证 券	202206140000 1416	卓 胜 微	2022-06 -14	735,280.00	4,000.00	14	1.90	543.29	-	-
中 信 证 券	202206140000 1417	沃 森 生 物	2022-06 -14	79,938.00	1,800.00	14	1.90	59.07	-	-
中 信 证 券	202206140000 1418	阳 光 电 源	2022-06 -14	1,522,919. 00	17,300.0 0	14	1.90	1,125.2 7	-	-
中 信 证 券	202206140000 1420	汇 川 技 术	2022-06 -14	1,737,904. 00	26,300.0 0	14	1.90	1,284.1 2	-	-
中 信 证 券	202206140000 1421	三 环 集 团	2022-06 -14	522,995.00	18,500.0 0	14	1.90	386.44	-	-
中 信 证 券	202206140000 1422	迈 瑞 医 疗	2022-06 -14	6,615,378. 00	22,200.0 0	14	1.90	4,888.0 3	-	-
中 信 证 券	202206140000 1423	宁 德 时 代	2022-06 -14	14,580,060 .00	33,000.0 0	14	1.90	10,773. 04	-	-
中	202206140000	亿	2022-06	4,546,531.	45,100.0	14	1.90	3,359.3	-	-

信 证 券	1431	纬 锂 能	-14	00	0			8		
中 信 证 券	202206140000 1432	深 信 服	2022-06 -14	351,085.00	3,500.00	14	1.90	259.41	-	-
中 信 证 券	202206140000 1433	中 科 创 达	2022-06 -14	657,550.00	5,000.00	14	1.90	485.86	-	-
中 信 证 券	202206140000 1434	康 龙 化 成	2022-06 -14	373,500.00	4,500.00	14	1.90	275.98	-	-
中 信 证 券	202206140000 1435	亿 联 网 络	2022-06 -14	351,900.00	4,600.00	14	1.90	260.02	-	-
中 信 证 券	202206140000 6452	蓝 思 科 技	2022-06 -14	1,032,175. 00	100,700. 00	14	1.80	722.52	-	-
中 信 证 券	202206140000 6462	智 飞 生 物	2022-06 -14	2,903,447. 00	32,300.0 0	14	1.80	2,032.4 1	-	-
中 信 证 券	202206140000 6466	泰 格 医 药	2022-06 -14	3,026,385. 00	32,700.0 0	14	1.80	2,118.4 7	-	-
中 信 证 券	202206140000 6468	迈 瑞 医 疗	2022-06 -14	3,248,091. 00	10,900.0 0	14	1.80	2,273.6 6	-	-
中 信 证 券	202206140000 6470	三 环 集 团	2022-06 -14	1,495,483. 00	52,900.0 0	14	1.80	1,046.8 4	-	-
中 信 证 券	202206140000 6472	沃 森 生 物	2022-06 -14	3,201,961. 00	72,100.0 0	14	1.80	2,241.3 7	-	-
中	202206140000	乐	2022-06	189,530.00	11,000.0	14	3.20	235.86	-	-

信 证 券	6670	普 医 疗	-14		0						
中 信 证 券	202206140000 7706	蓝 思 科 技	2022-06 -14	2,716,250. 00	265,000. 00	14	3.20	3,380.2 2	-	-	
中 信 证 券	202206140000 7860	亿 联 网 络	2022-06 -14	76,500.00	1,000.00	14	3.10	92.23	-	-	
中 信 证 券	202206140000 8046	迈 瑞 医 疗	2022-06 -14	595,980.00	2,000.00	14	2.90	672.13	-	-	
中 信 证 券	202206150000 3047	阳 光 电 源	2022-06 -15	346,880.00	4,000.00	28	2.80	404.69	393,230.21	404.69	
中 信 证 券	202206150000 3052	中 伟 股 份	2022-06 -15	5,950,500. 00	50,000.0 0	14	4.60	10,644. 78	-	-	
中 信 证 券	202206150002 3781	中 科 创 达	2022-06 -15	1,328,250. 00	10,500.0 0	14	1.80	929.78	-	-	
中 信 证 券	202206150002 4201	华 大 基 因	2022-06 -15	1,520,102. 00	22,900.0 0	14	3.00	1,773.4 5	-	-	
中 信 证 券	202206150002 4211	蓝 思 科 技	2022-06 -15	3,245,200. 00	305,000. 00	14	3.20	4,038.4 7	-	-	
中 信 证 券	202206150002 4221	中 科 创 达	2022-06 -15	2,441,450. 00	19,300.0 0	14	3.50	3,323.0 8	-	-	
中 信 证 券	202206150002 4229	迈 瑞 医 疗	2022-06 -15	3,301,870. 00	11,000.0 0	14	2.90	3,723.7 8	-	-	
中	202206160000	卓	2022-06	404,166.00	2,100.00	28	1.80	282.92	284,272.53	282.92	

信 证 券	1362	胜 微	-16							
中 信 证 券	202206160000 1364	中 伟 股 份	2022-06 -16	224,770.00	1,900.00	28	1.80	157.34	235,410.00	157.34
中 信 证 券	202206160000 1376	智 飞 生 物	2022-06 -16	744,338.00	7,900.00	28	1.80	521.04	876,979.00	521.04
中 信 证 券	202206160000 1378	亿 纬 锂 能	2022-06 -16	1,012,300. 00	10,600.0 0	28	1.80	708.61	1,033,500. 00	708.61
中 信 证 券	202206160000 1381	乐 普 医 疗	2022-06 -16	224,250.00	12,500.0 0	28	1.80	156.98	235,037.99	156.98
中 信 证 券	202206160000 1382	欣 旺 达	2022-06 -16	356,286.00	11,900.0 0	28	1.80	249.40	376,040.00	249.40
中 信 证 券	202206160000 1383	北 京 君 正	2022-06 -16	172,330.00	1,900.00	28	1.80	120.63	201,916.77	120.63
中 信 证 券	202206160000 1386	汇 川 技 术	2022-06 -16	1,155,220. 00	17,800.0 0	28	1.80	808.66	1,176,369. 19	808.66
中 信 证 券	202206160000 1387	沃 森 生 物	2022-06 -16	727,360.00	16,000.0 0	28	1.80	509.15	774,240.00	509.15
中 信 证 券	202206160000 1392	晶 盛 机 电	2022-06 -16	154,650.00	2,500.00	28	1.80	108.26	168,975.00	108.26
中 信 证 券	202206160000 1393	蓝 思 科 技	2022-06 -16	18,139.00	1,700.00	28	1.80	12.70	18,819.00	12.70
中	202206160000	汇	2022-06	64,900.00	1,000.00	28	1.80	45.43	66,088.16	45.43

信 证 券	1394	川 技 术	-16							
中 信 证 券	202206160000 1396	欣 旺 达	2022-06 -16	122,754.00	4,100.00	28	1.80	85.93	129,560.00	85.93
中 信 证 券	202206160000 1400	宁 德 时 代	2022-06 -16	598,390.00	1,300.00	28	1.80	418.88	694,200.00	418.88
中 信 证 券	202206160000 1402	圣 邦 股 份	2022-06 -16	459,000.00	1,800.00	28	1.80	321.30	327,663.23	321.30
中 信 证 券	202206160000 1406	华 大 基 因	2022-06 -16	167,325.00	2,500.00	28	1.80	117.13	179,250.00	117.13
中 信 证 券	202206160000 1408	康 泰 生 物	2022-06 -16	265,200.00	6,500.00	28	1.80	185.64	293,670.00	185.64
中 信 证 券	202206160000 1409	亿 联 网 络	2022-06 -16	270,288.00	3,600.00	28	1.80	189.20	274,140.00	189.20
中 信 证 券	202206160000 1412	康 龙 化 成	2022-06 -16	430,950.00	5,100.00	28	1.80	301.67	485,622.00	301.67
中 信 证 券	202206160000 1414	迈 瑞 医 疗	2022-06 -16	1,489,600. 00	4,900.00	28	1.80	1,042.7 2	1,534,680. 00	1,042.7 2
中 信 证 券	202206160000 1416	宁 德 时 代	2022-06 -16	2,025,320. 00	4,400.00	28	1.80	1,417.7 3	2,349,600. 00	1,417.7 3
中 信 证 券	202206160000 1418	迈 为 股 份	2022-06 -16	393,680.00	1,000.00	28	1.80	275.58	490,900.00	275.58
中	202206160000	泰	2022-06	495,020.00	5,300.00	28	1.80	346.52	606,585.00	346.52

信 证 券	1420	格 医 药	-16							
中 信 证 券	202206160000 1422	三 环 集 团	2022-06 -16	334,765.00	11,500.0 0	28	1.80	234.34	346,150.00	234.34
中 信 证 券	202206160000 1424	阳 光 电 源	2022-06 -16	973,188.00	10,800.0 0	28	1.80	681.23	1,061,721. 58	681.23
中 信 证 券	202206160000 1425	晶 盛 机 电	2022-06 -16	389,718.00	6,300.00	28	1.80	272.81	425,817.00	272.81
中 信 证 券	202206160000 1428	中 科 创 达	2022-06 -16	373,200.00	3,000.00	28	1.80	261.24	391,440.00	261.24
中 信 证 券	202206160000 1429	深 信 服	2022-06 -16	261,250.00	2,500.00	28	1.80	182.88	259,450.00	182.88
中 信 证 券	202206160000 1432	蓝 思 科 技	2022-06 -16	206,998.00	19,400.0 0	28	1.80	144.90	214,758.00	144.90
中 信 证 券	202206160000 1442	先 导 智 能	2022-06 -16	608,949.00	9,900.00	28	1.80	426.27	627,619.19	426.27
中 信 证 券	202206160000 1634	天 能 股 份	2022-06 -16	41,976.00	1,200.00	28	1.80	29.39	41,598.86	29.39
中 信 证 券	202206160000 1636	金 山 办 公	2022-06 -16	393,433.00	1,900.00	28	1.80	275.41	374,528.00	275.41
中 信 证 券	202206160000 1642	君 实 生 物	2022-06 -16	289,656.00	3,600.00	28	1.80	202.76	271,224.00	202.76
中	202206160000	时	2022-06	102,600.00	1,800.00	28	1.80	71.82	116,982.00	71.82

信 证 券	1644	代 电 气	-16							
中 信 证 券	202206160000 1645	容 百 科 技	2022-06 -16	302,400.00	2,700.00	28	1.80	211.68	349,488.00	211.68
中 信 证 券	202206160000 1648	华 润 微	2022-06 -16	307,372.00	5,200.00	28	1.80	215.16	307,893.58	215.16
中 信 证 券	202206160000 1650	和 辉 光 电	2022-06 -16	74,256.00	27,300.0 0	28	1.80	51.98	73,164.00	51.98
中 信 证 券	202206160000 1654	大 全 能 源	2022-06 -16	143,346.00	2,100.00	28	1.80	100.34	143,472.00	100.34
中 信 证 券	202206160000 1656	澜 起 科 技	2022-06 -16	306,765.00	5,100.00	28	1.80	214.74	308,958.00	214.74
中 信 证 券	202206160000 1658	传 音 控 股	2022-06 -16	253,250.00	2,500.00	28	1.80	177.28	224,554.36	177.28
中 信 证 券	202206160000 1659	沪 硅 产 业	2022-06 -16	262,472.00	10,900.0 0	28	1.80	183.73	250,482.00	183.73
中 信 证 券	202206160000 1662	中 微 公 司	2022-06 -16	459,496.00	3,800.00	28	1.80	321.65	443,650.00	321.65
中 信 证 券	202206160000 1663	中 国 通 号	2022-06 -16	119,808.00	25,600.0 0	28	1.80	83.87	115,968.00	83.87
中 信 证 券	202206160000 1666	九 号 公 司	2022-06 -16	166,565.00	3,500.00	28	1.80	116.60	155,750.00	116.60
中	202206160000	康	2022-06	185,280.00	1,000.00	28	1.80	129.70	199,080.00	129.70

信 证 券	1668	希 诺	-16							
中 信 证 券	202206160000 1670	中 控 技 术	2022-06 -16	232,050.00	3,000.00	28	1.80	162.44	218,280.00	162.44
中 信 证 券	202206160000 1672	格 科 微	2022-06 -16	40,780.00	2,000.00	28	1.80	28.55	41,020.00	28.55
中 信 证 券	202206160000 1674	和 辉 光 电	2022-06 -16	27,200.00	10,000.0 0	28	1.80	19.04	26,800.00	19.04
中 信 证 券	202206160000 1676	天 合 光 能	2022-06 -16	696,852.00	11,700.0 0	28	1.80	487.80	763,425.00	487.80
中 信 证 券	202206160000 1678	珠 海 冠 宇	2022-06 -16	32,560.00	1,100.00	28	1.80	22.79	33,770.00	22.79
中 信 证 券	202206160000 1680	奇 安 信	2022-06 -16	146,664.00	2,800.00	28	1.80	102.67	156,240.00	102.67
中 信 证 券	202206160000 1682	石 头 科 技	2022-06 -16	660,900.00	1,000.00	28	1.80	462.63	616,700.00	462.63
中 信 证 券	202206160000 1684	中 芯 国 际	2022-06 -16	847,854.00	18,900.0 0	28	1.80	593.50	853,713.00	593.50
中 信 证 券	202206160000 1686	凯 赛 生 物	2022-06 -16	124,200.00	1,200.00	28	1.80	86.94	134,160.00	86.94
中 信 证 券	202206160001 2159	华 大 基 因	2022-06 -16	1,338,600. 00	20,000.0 0	14	3.00	1,561.7 0	-	-
中	202206160001	欣	2022-06	2,212,566.	73,900.0	14	3.70	3,183.6	-	-

信 证 券	2199	旺 达	-16	00	0			4		
中 信 证 券	202206160001 5631	三 环 集 团	2022-06 -16	29,110.00	1,000.00	14	3.20	36.23	-	-
中 信 证 券	202206160001 5639	亿 纬 锂 能	2022-06 -16	477,500.00	5,000.00	14	3.20	594.22	-	-
中 信 证 券	202206160001 7749	中 伟 股 份	2022-06 -16	1,183,000. 00	10,000.0 0	14	1.80	828.10	-	-
中 信 证 券	202206170001 4188	天 能 股 份	2022-06 -16	720.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206200001 5560	北 京 君 正	2022-06 -07	5,263.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202206200001 5606	北 京 君 正	2022-06 -09	190.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206200001 5693	北 京 君 正	2022-06 -16	361.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206210000 1464	康 泰 生 物	2022-06 -21	2,308,920. 00	54,200.0 0	14	2.30	1,327.6 3	2,448,756. 00	1,327.6 3
中 信 证 券	202206210000 8034	迈 为 股 份	2022-06 -21	2,221,548. 00	5,300.00	14	3.90	2,166.0 1	2,601,770. 00	2,166.0 1
中 信 证 券	202206210000 9678	沃 森 生 物	2022-06 -21	2,419,455. 00	50,500.0 0	14	2.40	1,451.6 7	2,443,695. 00	1,451.6 7
中	202206210000	北	2022-06	2,507,404.	27,700.0	14	2.90	1,817.8	2,943,734.	1,817.8

信 证 券	9708	京 君 正	-21	00	0			7	00	7
中 信 证 券	202206210001 0133	圣 邦 股 份	2022-06 -14	1,400.00	-	14	1.90	-	-	-
中 信 证 券	202206210001 0171	圣 邦 股 份	2022-06 -16	900.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206210001 0375	圣 邦 股 份	2022-06 -14	-	1,400.00	14	1.90	-	-	-
中 信 证 券	202206210001 0413	圣 邦 股 份	2022-06 -16	-	900.00	28	1.80	-	163,831.61	-
中 信 证 券	202206220001 3355	蓝 思 科 技	2022-06 -22	104,940.00	9,900.00	14	2.10	48.97	109,593.00	48.97
中 信 证 券	202206220001 3563	欣 旺 达	2022-06 -22	195,480.00	6,000.00	14	3.10	134.66	189,600.00	134.66
中 信 证 券	202206220001 3619	欣 旺 达	2022-06 -22	2,524,950. 00	77,500.0 0	14	3.10	1,739.4 1	2,449,000. 00	1,739.4 1
中 信 证 券	202206220001 6815	传 音 控 股	2022-06 -09	1,800.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206220001 6920	传 音 控 股	2022-06 -16	3,750.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206230000 1762	迈 瑞 医 疗	2022-06 -23	2,267,818. 00	7,300.00	28	1.80	793.74	2,286,360. 00	793.74
中	202206230000	智	2022-06	98,900.00	1,000.00	28	1.80	34.62	111,010.00	34.62

信 证 券	1767	飞 生 物	-23							
中 信 证 券	202206230000 1769	康 泰 生 物	2022-06 -23	1,044,804. 00	24,900.0 0	28	1.80	365.68	1,124,982. 00	365.68
中 信 证 券	202206230000 1771	乐 普 医 疗	2022-06 -23	920,496.00	50,800.0 0	28	1.80	322.17	955,194.39	322.17
中 信 证 券	202206230000 7787	乐 普 医 疗	2022-06 -23	77,916.00	4,300.00	14	1.80	27.27	80,853.07	27.27
中 信 证 券	202206230000 7793	阳 光 电 源	2022-06 -23	4,903,785. 00	53,100.0 0	14	1.90	1,811.6 8	5,220,131. 10	1,811.6 8
中 信 证 券	202206230000 7795	蓝 思 科 技	2022-06 -23	54,723.00	5,100.00	14	1.80	19.16	56,457.00	19.16
中 信 证 券	202206230000 7799	阳 光 电 源	2022-06 -23	313,990.00	3,400.00	14	1.80	109.90	334,245.68	109.90
中 信 证 券	202206230000 7803	泰 格 医 药	2022-06 -23	176,418.00	1,800.00	14	1.80	61.75	206,010.00	61.75
中 信 证 券	202206230000 7805	北 京 君 正	2022-06 -23	93,450.00	1,000.00	14	1.80	32.71	106,271.99	32.71
中 信 证 券	202206230000 7807	三 环 集 团	2022-06 -23	108,558.00	3,700.00	14	1.80	38.00	111,370.00	38.00
中 信 证 券	202206230000 7809	亿 纬 锂 能	2022-06 -23	406,600.00	3,800.00	14	1.80	142.31	370,500.00	142.31
中	202206230000	智	2022-06	247,250.00	2,500.00	14	1.80	86.54	277,525.00	86.54

信 证 券	7811	飞 生 物	-23							
中 信 证 券	202206230000 7823	沃 森 生 物	2022-06 -23	254,610.00	5,400.00	14	1.80	89.12	261,306.00	89.12
中 信 证 券	202206230000 7829	汇 川 技 术	2022-06 -23	360,665.00	5,300.00	14	1.80	126.24	350,267.23	126.24
中 信 证 券	202206230000 7875	华 大 基 因	2022-06 -23	67,490.00	1,000.00	14	1.80	23.62	71,700.00	23.62
中 信 证 券	202206230000 7877	卓 胜 微	2022-06 -23	204,450.00	1,000.00	14	1.80	71.56	135,367.87	71.56
中 信 证 券	202206230000 7879	中 科 创 达	2022-06 -23	141,830.00	1,000.00	14	1.80	49.64	130,480.00	49.64
中 信 证 券	202206230000 7881	迈 瑞 医 疗	2022-06 -23	621,320.00	2,000.00	14	1.80	217.46	626,400.00	217.46
中 信 证 券	202206230000 7883	康 龙 化 成	2022-06 -23	87,060.00	1,000.00	14	1.80	30.47	95,220.00	30.47
中 信 证 券	202206230000 7885	深 信 服	2022-06 -23	104,200.00	1,000.00	14	1.80	36.47	103,780.00	36.47
中 信 证 券	202206230000 7887	亿 联 网 络	2022-06 -23	72,680.00	1,000.00	14	1.80	25.44	76,150.00	25.44
中 信 证 券	202206230000 7893	先 导 智 能	2022-06 -23	218,176.00	3,200.00	14	1.80	76.36	202,866.81	76.36
中	202206230000	澜	2022-06	124,850.00	2,200.00	14	1.80	43.70	133,276.00	43.70

信 证 券	7897	起 科 技	-23							
中 信 证 券	202206230000 8421	时 代 电 气	2022-06 -23	175,050.00	3,000.00	14	1.80	61.27	194,970.00	61.27
中 信 证 券	202206230000 8423	珠 海 冠 宇	2022-06 -23	96,480.00	3,000.00	14	1.80	33.77	92,100.00	33.77
中 信 证 券	202206230000 8425	君 实 生 物	2022-06 -23	74,920.00	1,000.00	14	1.80	26.22	75,340.00	26.22
中 信 证 券	202206230000 8427	华 润 微	2022-06 -23	73,892.00	1,300.00	14	1.80	25.86	76,973.39	25.86
中 信 证 券	202206230000 8429	传 音 控 股	2022-06 -23	105,816.00	1,200.00	14	1.80	37.04	107,786.09	37.04
中 信 证 券	202206230000 8433	沪 硅 产 业	2022-06 -23	54,240.00	2,400.00	14	1.80	18.99	55,152.00	18.99
中 信 证 券	202206230000 8435	中 微 公 司	2022-06 -23	152,126.00	1,300.00	14	1.80	53.25	151,775.00	53.25
中 信 证 券	202206230000 8439	中 芯 国 际	2022-06 -23	244,750.00	5,500.00	14	1.80	85.67	248,435.00	85.67
中 信 证 券	202206230000 8443	金 山 办 公	2022-06 -23	197,950.00	1,000.00	14	1.80	69.29	197,120.00	69.29
中 信 证 券	202206230000 8445	中 国 通 号	2022-06 -23	57,125.00	12,500.00	14	1.80	20.00	56,625.00	20.00
中	202206230000	泰	2022-06	254,826.00	2,600.00	14	1.80	89.19	297,570.00	89.19

信 证 券	9119	格 医 药	-23							
中 信 证 券	202206230000 9127	智 飞 生 物	2022-06 -23	385,710.00	3,900.00	14	1.80	135.00	432,939.00	135.00
中 信 证 券	202206230000 9131	亿 联 网 络	2022-06 -23	130,824.00	1,800.00	14	1.80	45.79	137,070.00	45.79
中 信 证 券	202206230000 9151	迈 瑞 医 疗	2022-06 -23	776,650.00	2,500.00	14	1.80	271.83	783,000.00	271.83
中 信 证 券	202206230000 9453	深 信 服	2022-06 -23	104,200.00	1,000.00	14	3.50	70.92	103,780.00	70.92
中 信 证 券	202206230000 9457	康 泰 生 物	2022-06 -23	125,880.00	3,000.00	14	3.40	83.22	135,540.00	83.22
中 信 证 券	202206230000 9533	康 龙 化 成	2022-06 -23	113,178.00	1,300.00	14	1.80	39.61	123,786.00	39.61
中 信 证 券	202206230000 9535	康 泰 生 物	2022-06 -23	83,920.00	2,000.00	14	1.80	29.37	90,360.00	29.37
中 信 证 券	202206230000 9537	卓 胜 微	2022-06 -23	245,340.00	1,200.00	14	1.80	85.87	162,441.44	85.87
中 信 证 券	202206230000 9541	时 代 电 气	2022-06 -23	58,350.00	1,000.00	14	1.80	20.43	64,990.00	20.43
中 信 证 券	202206230000 9543	深 信 服	2022-06 -23	104,200.00	1,000.00	14	1.80	36.47	103,780.00	36.47
中	202206230000	欣	2022-06	206,441.00	5,900.00	14	1.80	72.26	186,440.00	72.26

信 证 券	9555	旺 达	-23							
中 信 证 券	202206230000 9819	深 信 服	2022-06 -23	625,200.00	6,000.00	14	3.50	425.49	622,680.00	425.49
中 信 证 券	202206230000 9823	迈 为 股 份	2022-06 -23	448,700.00	1,000.00	14	3.90	340.27	490,900.00	340.27
中 信 证 券	202206230001 1814	华 润 微	2022-06 -16	893.36	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206230001 2089	华 润 微	2022-06 -23	223.34	-	14	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206240000 9661	先 导 智 能	2022-06 -14	29,950.00	-	14	1.90	-	-	-
中 信 证 券	202206240000 9739	先 导 智 能	2022-06 -16	4,950.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206240000 9946	先 导 智 能	2022-06 -23	1,600.00	-	14	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206270001 6953	阳 光 电 源	2022-06 -14	1,911.35	-	14	1.90	-	-	-
中 信 证 券	202206270001 7000	阳 光 电 源	2022-06 -15	441.93	-	28	2.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206270001 7051	阳 光 电 源	2022-06 -16	1,193.21	-	28	1.80	-	0.00	-
中	202206270001	阳	2022-06	5,866.62	-	14	1.90	-	0.00	-

信 证 券	7374	光 电 源	-23							
中 信 证 券	202206270001 7376	阳 光 电 源	2022-06 -23	375.64	-	14	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206280000 1655	天 合 光 能	2022-06 -28	34,450,000 .00	500,000. 00	14	2.80	5,358.8 9	32,625,000 .00	5,358.8 9
中 信 证 券	202206280000 9112	圣 邦 股 份	2022-06 -28	509,824.00	2,800.00	14	1.90	53.81	509,698.35	53.81
中 信 证 券	202206280000 9114	智 飞 生 物	2022-06 -28	3,288,176. 00	30,200.0 0	14	1.90	347.09	3,352,502. 00	347.09
中 信 证 券	202206280000 9116	卓 胜 微	2022-06 -28	843,520.00	4,000.00	14	1.90	89.04	541,471.48	89.04
中 信 证 券	202206280000 9118	康 龙 化 成	2022-06 -28	419,580.00	4,500.00	14	1.90	44.29	428,490.00	44.29
中 信 证 券	202206280000 9124	迈 瑞 医 疗	2022-06 -28	7,034,736. 00	22,200.0 0	14	1.90	742.56	6,953,040. 00	742.56
中 信 证 券	202206280000 9140	亿 联 网 络	2022-06 -28	78,090.00	1,000.00	14	3.30	14.32	76,150.00	14.32
中 信 证 券	202206280000 9960	蓝 思 科 技	2022-06 -28	2,970,650. 00	265,000. 00	14	3.00	495.11	2,933,550. 00	495.11
中 信 证 券	202206280001 0582	蓝 思 科 技	2022-06 -28	1,128,847. 00	100,700. 00	14	1.80	112.88	1,114,749. 00	112.88
中	202206280001	三	2022-06	1,571,659.	52,900.0	14	1.80	157.17	1,592,290.	157.17

信 证 券	0584	环 集 团	-28	00	0				00	
中 信 证 券	202206280001 0586	泰 格 医 药	2022-06 -28	3,599,943. 00	32,700.0 0	14	1.80	359.99	3,742,515. 00	359.99
中 信 证 券	202206280001 0588	智 飞 生 物	2022-06 -28	3,516,824. 00	32,300.0 0	14	1.80	351.68	3,585,623. 00	351.68
中 信 证 券	202206280001 0590	沃 森 生 物	2022-06 -28	3,331,741. 00	72,100.0 0	14	1.80	333.17	3,488,919. 00	333.17
中 信 证 券	202206280001 0592	迈 瑞 医 疗	2022-06 -28	3,453,992. 00	10,900.0 0	14	1.80	345.40	3,413,880. 00	345.40
中 信 证 券	202206280001 0808	阳 光 电 源	2022-06 -28	1,679,311. 00	17,300.0 0	14	1.90	177.26	1,700,720. 68	177.26
中 信 证 券	202206280001 0810	宁 德 时 代	2022-06 -28	17,952,000 .00	33,000.0 0	14	1.90	1,894.9 3	17,622,000 .00	1,894.9 3
中 信 证 券	202206280001 0818	中 科 创 达	2022-06 -28	690,200.00	5,000.00	14	1.90	72.85	652,400.00	72.85
中 信 证 券	202206280001 0820	深 信 服	2022-06 -28	355,635.00	3,500.00	14	1.90	37.54	363,230.00	37.54
中 信 证 券	202206280001 0830	亿 联 网 络	2022-06 -28	359,214.00	4,600.00	14	1.90	37.92	350,290.00	37.92
中 信 证 券	202206280001 0834	亿 纬 锂 能	2022-06 -28	605,114.00	45,100.0 0	14	1.90	496.67	4,397,250. 00	496.67
中	202206280001	汇	2022-06	1,822,064.	26,300.0	14	1.90	192.33	1,738,118.	192.33

信 证 券	0836	川 技 术	-28	00	0				53	
中 信 证 券	202206280001 0838	先 导 智 能	2022-06 -28	4,064,215. 00	59,900.0 0	14	1.90	429.00	3,797,413. 09	429.00
中 信 证 券	202206280001 0840	三 环 集 团	2022-06 -28	549,635.00	18,500.0 0	14	1.90	58.02	556,850.00	58.02
中 信 证 券	202206280001 0846	沃 森 生 物	2022-06 -28	83,178.00	1,800.00	14	1.90	8.78	87,102.00	8.78
中 信 证 券	202206280001 0862	乐 普 医 疗	2022-06 -28	205,590.00	11,000.0 0	14	2.70	30.84	206,833.43	30.84
中 信 证 券	202206280001 0866	迈 瑞 医 疗	2022-06 -28	633,760.00	2,000.00	14	2.70	95.06	626,400.00	95.06
中 信 证 券	202206280001 2375	汇 川 技 术	2022-06 -16	5,340.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206280001 2377	汇 川 技 术	2022-06 -16	300.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206280001 2600	汇 川 技 术	2022-06 -23	1,590.00	-	14	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206280001 2680	汇 川 技 术	2022-06 -28	7,890.00	-	14	1.90	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 1946	中 科 创 达	2022-06 -29	2,535,248. 00	19,300.0 0	14	3.00	211.27	2,518,264. 00	211.27
中	202206290002	迈	2022-06	3,432,000.	11,000.0	14	2.70	257.40	3,445,200.	257.40

信 证 券	1948	瑞 医 疗	-29	00	0				00	
中 信 证 券	202206290002 2004	中 伟 股 份	2022-06 -29	6,195,000. 00	50,000.0 0	14	4.40	757.17	6,195,000. 00	757.17
中 信 证 券	202206290002 3442	华 大 基 因	2022-06 -29	1,602,313. 00	22,900.0 0	14	3.30	146.88	1,641,930. 00	146.88
中 信 证 券	202206290002 3444	蓝 思 科 技	2022-06 -29	3,376,350. 00	305,000. 00	14	3.00	281.36	3,376,350. 00	281.36
中 信 证 券	202206290002 7021	乐 普 医 疗	2022-06 -16	3,437.50	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 7175	乐 普 医 疗	2022-06 -23	13,970.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 7178	乐 普 医 疗	2022-06 -23	1,182.50	-	14	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 7258	乐 普 医 疗	2022-06 -28	3,025.00	-	14	2.70	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 7451	卓 胜 微	2022-06 -16	1,470.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 7654	卓 胜 微	2022-06 -23	700.00	-	14	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 7672	卓 胜 微	2022-06 -23	840.00	-	14	1.80	-	0.00	-
中	202206290002	卓	2022-06	2,800.00	-	14	1.90	-	0.00	-

信 证 券	7714	胜 微	-28								
中 信 证 券	202206290002 7803	卓 胜 微	2022-06 -16	-	1,260.00	28	1.80	-	170,563.52	-	
中 信 证 券	202206290002 8006	卓 胜 微	2022-06 -23	-	600.00	14	1.80	-	81,220.72	-	
中 信 证 券	202206290002 8024	卓 胜 微	2022-06 -23	-	720.00	14	1.80	-	97,464.87	-	
中 信 证 券	202206290002 8066	卓 胜 微	2022-06 -28	-	2,400.00	14	1.90	-	324,882.89	-	
中 信 证 券	202206300002 0959	欣 旺 达	2022-06 -30	2,335,240. 00	73,900.0 0	14	2.90	2,633.6 3	2,335,240. 00	-	
中 信 证 券	202206300002 1557	华 大 基 因	2022-06 -30	1,434,000. 00	20,000.0 0	14	3.30	1,840.3 0	1,434,000. 00	-	
中 信 证 券	202207050001 2035	华 大 基 因	2022-06 -16	875.00	-	28	1.80	-	0.00	-	
中 信 证 券	202207050001 2108	华 大 基 因	2022-06 -23	350.00	-	14	1.80	-	0.00	-	
中 信 证 券	202207050001 2268	华 大 基 因	2022-06 -29	8,015.00	-	14	3.30	-	0.00	-	
中 信 证 券	202207050001 2406	华 大 基 因	2022-06 -30	7,000.00	-	14	3.30	-	0.00	-	
中	202207070001	欣	2022-06	833.16	-	28	1.80	-	0.00	-	

信 证 券	0116	旺 达	-16							
中 信 证 券	202207070001 0118	欣 旺 达	2022-06 -16	287.05	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202207070001 0321	欣 旺 达	2022-06 -30	5,173.99	-	14	2.90	-	0.00	-
中 信 证 券	202207070001 1274	亿 纬 锂 能	2022-06 -16	1,696.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202207070001 1371	亿 纬 锂 能	2022-06 -28	7,216.00	-	14	1.90	-	0.00	-
中 信 证 券	202207070001 2144	石 头 科 技	2022-06 -16	2,100.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202207080000 8749	石 头 科 技	2022-06 -16	-	400.00	28	1.80	-	246,680.00	-
中 信 证 券	202207140001 8617	智 飞 生 物	2022-06 -23	600.00	-	28	1.80	-	0.00	-

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
-------	---------------------	-----------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏科创创业 50ETF 发起式联接	936,920,304.00	12.67%	830,920,437.00	12.65%
中信证券	10,605,316.00	0.14%	5,971,457.00	0.09%

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	14,092,292.24	23,231.74	19,120,066.20	41,905.65

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688343	云天励飞	新股发行	24,961	1,096,287.12
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	4,299	200,677.32
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00

中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	600938	中国海油	新股发行	3,000	32,400.00
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				类型						
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新发流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内(含)	新发流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新发流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-

301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新发流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023-01-20	6 个月	新发流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新发流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新发	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-

				流通受限						
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新发流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新发流通	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-

				受限						
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	含 证 券 送 配
301310	鑫宏业	2023-05-26	6 个月	新发流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新发流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新发流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新发流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	新发流通受限	131.11	53.24	391	34,219.71	20,816.84	含 证 券 送 配
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新发	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-

				流通受限						
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6 个月	新发流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新发流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新发流通	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-

				受限						
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-

301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新发 流通 受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688433	华曙 高科	2023-04-07	6 个月	新发 流通 受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301360	荣旗 科技	2023-04-17	6 个月	新发 流通 受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301345	涛涛 车业	2023-03-10	6 个月	新发 流通 受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301292	海科 新源	2023-06-29	6 个月	新发 流通 受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
688523	航天 环宇	2023-05-26	6 个月	新发 流通 受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重 科技	2023-03-29	6 个月	新发 流通 受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301141	中科 磁业	2023-03-27	6 个月	新发	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-

				流通受限						
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新发流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新发流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新发流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新发流通	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-

				受限						
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新发流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新发流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新发流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

301281	科源 制药	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	含 证 券 送 配
688535	华海 诚科	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚 股份	2023-03-31	6 个月	新发 流通 受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑 科技	2023-03-01	6 个月	新发 流通 受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威 股份	2023-06-28	6 个月	新发 流通 受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕 科技	2023-06-19	6 个月	新发 流通 受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰 环保	2023-03-28	6 个月	新发 流通 受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688603	天承 科技	2023-06-30	6 个月	新发	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-

				流通受限						
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新发流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新发流通	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-

				受限						
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

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

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的

约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（股）	期末估值总额
1	688111	金山办公	2023年7月12日 -2023年7月14日	472.22	82,300.00	38,863,706.00
2	688036	传音控股	2023年7月11日 -2023年7月14日	147.00	142,400.00	20,932,800.00
3	688008	澜起科技	2023年7月3日 -2023年7月14日	57.42	310,200.00	17,811,684.00
4	300450	先导智能	2023年7月10日 -2023年7月14日	36.17	440,900.00	15,947,353.00
5	688777	中控技术	2023年7月5日 -2023年7月14日	62.78	176,405.00	11,074,705.90
6	300763	锦浪科技	2023年7月4日 -2023年7月14日	104.10	100,500.00	10,462,050.00
7	300760	迈瑞医疗	2023年7月5日 -2023年7月14日	299.80	30,600.00	9,173,880.00
8	300750	宁德时代	2023年7月3日 -2023年7月14日	228.79	35,200.00	8,053,408.00
9	688005	容百科技	2023年7月4日 -2023年7月14日	54.02	134,800.00	7,281,896.00
10	688063	派能科技	2023年7月4日 -2023年7月14日	198.25	35,300.00	6,998,225.00
11	300274	阳光电源	2023年7月4日 -2023年7月14日	116.63	55,100.00	6,426,313.00
12	300122	智飞生物	2023年7月5日 -2023年7月14日	44.20	106,350.00	4,700,670.00
13	300124	汇川技术	2023年7月13日	64.21	63,100.00	4,051,651.00

			-2023 年 7 月 14 日			
14	688981	中芯国际	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	50.52	66,500.00	3,359,580.00
15	300347	泰格医药	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	64.54	43,500.00	2,807,490.00
16	300142	沃森生物	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	26.45	98,000.00	2,592,100.00
17	300782	卓胜微	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	96.63	26,400.00	2,551,032.00
18	300408	三环集团	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	29.35	86,700.00	2,544,645.00
19	300014	亿纬锂能	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	60.50	41,700.00	2,522,850.00
20	300207	欣旺达	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	16.32	154,200.00	2,516,544.00
21	688012	中微公司	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	156.45	14,700.00	2,299,815.00
22	300496	中科创达	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	96.35	23,100.00	2,225,685.00
23	300661	圣邦股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	82.13	25,990.00	2,134,558.70
24	300316	晶盛机电	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	70.90	25,200.00	1,786,680.00
25	300454	深信服	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	113.25	14,800.00	1,676,100.00
26	688599	天合光能	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	42.61	36,900.00	1,572,309.00
27	688180	君实生物	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	38.54	40,500.00	1,560,870.00
28	300433	蓝思科技	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	11.76	123,700.00	1,454,712.00
29	301269	华大九天	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	122.84	9,900.00	1,216,116.00
30	300759	康龙化成	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	38.28	29,600.00	1,133,088.00
31	300769	德方纳米	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	110.23	10,000.00	1,102,300.00
32	688126	沪硅产业	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	20.90	46,400.00	969,760.00
33	688223	晶科能源	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	14.06	67,900.00	954,674.00
34	688396	华润微	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	52.41	17,900.00	938,139.00
35	688303	大全能源	2023 年 7 月 13 日	40.45	21,800.00	881,810.00

			-2023 年 7 月 14 日			
36	688561	奇安信	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	51.81	15,500.00	803,055.00
37	300751	迈为股份	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	169.38	4,700.00	796,086.00
38	688187	时代电气	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	41.86	17,900.00	749,294.00
39	300223	北京君正	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	88.31	8,200.00	724,142.00
40	688348	昱能科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	187.83	3,800.00	713,754.00
41	688032	禾迈股份	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	355.15	2,000.00	710,300.00
42	300628	亿联网络	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	35.07	17,200.00	603,204.00
43	300919	中伟股份	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	60.25	9,200.00	554,300.00
44	688041	海光信息	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	68.27	7,900.00	539,333.00
45	688114	华大智造	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	86.56	6,000.00	519,360.00
46	688009	中国通号	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	5.80	87,900.00	509,820.00
47	688349	三一重能	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	32.22	12,200.00	393,084.00
48	688728	格科微	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	15.82	21,300.00	336,966.00
49	688271	联影医疗	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 14 日	138.01	2,200.00	303,622.00
50	688065	凯赛生物	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	62.26	2,300.00	143,198.00
合计	-	-	-	-	2,956,845.00	210,978,717.60

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

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

感性指标来衡量市场风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,232,330,166.67	99.68	3,987,322,238.47	99.83
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,840,430.37	0.07	747,599.90	0.02
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	4,235,170,597.04	99.75	3,988,069,838.37	99.85

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证科创创业 50 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	-5%	-217,154,114.60	-197,205,639.18
	+5%	217,154,114.60	197,205,639.18

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	4,232,552,538.53
第二层次	865,434.18
第三层次	1,752,624.33
合计	4,235,170,597.04

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

##### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,232,330,166.67	99.12
	其中：股票	4,232,330,166.67	99.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,840,430.37	0.07
	其中：债券	2,840,430.37	0.07
	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	14,751,437.97	0.35
8	其他各项资产	19,932,374.15	0.47
9	合计	4,269,854,409.16	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 210,978,717.60 元, 占本基金期末资产净值的 4.97%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,669,651,300.53	86.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	38,587.92	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	438,801,037.90	10.33
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	123,744,973.78	2.91
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,232,325,837.67	99.68

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,938,036	443,403,256.44	10.44
2	300760	迈瑞医疗	1,059,883	317,752,923.40	7.48
3	300274	阳光电源	2,269,782	264,724,674.66	6.23
4	300124	汇川技术	4,068,975	261,268,884.75	6.15
5	688981	中芯国际	4,276,907	216,069,341.64	5.09
6	688111	金山办公	406,037	191,738,792.14	4.52
7	300014	亿纬锂能	2,678,097	162,024,868.50	3.82
8	688012	中微公司	945,884	147,983,551.80	3.49
9	300122	智飞生物	2,618,441	115,735,092.20	2.73
10	688036	传音控股	702,644	103,288,668.00	2.43
11	300316	晶盛机电	1,430,100	101,394,090.00	2.39
12	688599	天合光能	2,374,517	101,178,169.37	2.38
13	688008	澜起科技	1,737,600	99,772,992.00	2.35
14	300142	沃森生物	3,511,634	92,882,719.30	2.19
15	300450	先导智能	2,392,682	86,543,307.94	2.04
16	300408	三环集团	2,930,069	85,997,525.15	2.03
17	300782	卓胜微	817,355	78,981,013.65	1.86
18	300347	泰格医药	1,145,899	73,956,321.46	1.74
19	300496	中科创达	697,776	67,230,717.60	1.58
20	688777	中控技术	1,030,373	64,686,816.94	1.52
21	688126	沪硅产业	2,984,316	62,372,204.40	1.47
22	300454	深信服	546,712	61,915,134.00	1.46
23	688223	晶科能源	4,371,369	61,461,448.14	1.45
24	688396	华润微	1,154,199	60,491,569.59	1.42
25	300661	圣邦股份	717,026	58,889,345.38	1.39
26	688303	大全能源	1,401,085	56,673,888.25	1.33
27	300769	德方纳米	483,400	53,285,182.00	1.25
28	300207	欣旺达	3,251,100	53,057,952.00	1.25
29	300751	迈为股份	303,999	51,491,350.62	1.21
30	300433	蓝思科技	4,346,970	51,120,367.20	1.20

31	300759	康龙化成	1,300,644	49,788,652.32	1.17
32	300223	北京君正	527,000	46,539,370.00	1.10
33	300763	锦浪科技	435,806	45,367,404.60	1.07
34	300628	亿联网络	1,104,166	38,723,101.62	0.91
35	688063	派能科技	188,617	37,393,320.25	0.88
36	688005	容百科技	689,807	37,263,374.14	0.88
37	300919	中伟股份	586,060	35,310,115.00	0.83
38	688041	海光信息	509,049	34,752,775.23	0.82
39	688009	中国通号	5,651,020	32,775,916.00	0.77
40	688180	君实生物	837,308	32,269,850.32	0.76
41	688561	奇安信	599,086	31,038,645.66	0.73
42	688032	禾迈股份	71,474	25,383,991.10	0.60
43	688065	凯赛生物	385,552	24,004,467.52	0.57
44	688187	时代电气	569,790	23,851,409.40	0.56
45	301269	华大九天	179,768	22,082,701.12	0.52
46	688728	格科微	1,091,956	17,274,743.92	0.41
47	688271	联影医疗	124,015	17,115,310.15	0.40
48	688348	昱能科技	72,228	13,566,585.24	0.32
49	688349	三一重能	316,036	10,182,679.92	0.24
50	688114	华大智造	80,412	6,960,462.72	0.16
51	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.01
52	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
53	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.00
54	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.00
55	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
56	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
57	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
58	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
59	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
60	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
61	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
62	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
63	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
64	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
65	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
66	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
67	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
68	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
69	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
70	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
71	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
72	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
73	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00

74	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
75	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
76	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
77	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
78	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
79	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
80	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
81	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
82	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
83	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
84	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
85	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
86	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
87	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
88	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
89	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
90	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
91	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
92	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
93	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
94	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
95	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
96	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
97	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
98	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
99	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
100	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
101	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
102	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
103	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
104	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
105	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
106	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
107	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
108	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
109	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
110	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
111	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
112	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
113	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
114	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
115	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
116	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00

117	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
118	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
119	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
120	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
121	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
122	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
123	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
124	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
125	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
126	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
127	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
128	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
129	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
130	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
131	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
132	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
133	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
134	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
135	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
136	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688111	金山办公	49,536,648.38	1.24
2	688981	中芯国际	47,997,338.99	1.20
3	688063	派能科技	41,448,364.06	1.04
4	688303	大全能源	39,062,609.92	0.98
5	688041	海光信息	31,879,070.79	0.80
6	688012	中微公司	30,636,920.21	0.77
7	300750	宁德时代	30,154,273.12	0.75
8	688599	天合光能	25,508,329.13	0.64
9	688223	晶科能源	25,384,422.43	0.64
10	688032	禾迈股份	25,176,209.49	0.63
11	688126	沪硅产业	23,110,371.80	0.58
12	688008	澜起科技	22,686,956.53	0.57
13	688271	联影医疗	20,548,286.20	0.51
14	688036	传音控股	17,383,863.51	0.44
15	688777	中控技术	15,830,290.57	0.40
16	688396	华润微	14,258,046.78	0.36
17	688005	容百科技	12,878,295.39	0.32

18	300782	卓胜微	11,013,375.45	0.28
19	300124	汇川技术	10,718,797.00	0.27
20	688728	格科微	9,478,262.10	0.24

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	58,786,046.43	1.47
2	688169	石头科技	37,886,891.44	0.95
3	300601	康泰生物	36,688,187.09	0.92
4	688111	金山办公	33,246,732.31	0.83
5	688536	思瑞浦	30,036,844.75	0.75
6	688981	中芯国际	26,305,224.37	0.66
7	688538	和辉光电	22,921,202.83	0.57
8	688012	中微公司	15,698,809.53	0.39
9	688599	天合光能	15,401,643.51	0.39
10	688008	澜起科技	13,404,404.19	0.34
11	688777	中控技术	13,209,392.82	0.33
12	300124	汇川技术	12,006,914.00	0.30
13	300760	迈瑞医疗	9,417,855.12	0.24
14	688036	传音控股	9,280,618.15	0.23
15	688396	华润微	8,008,886.68	0.20
16	300274	阳光电源	5,899,348.00	0.15
17	688126	沪硅产业	5,140,542.74	0.13
18	688180	君实生物	5,121,437.18	0.13
19	688063	派能科技	5,024,961.33	0.13
20	688561	奇安信	4,879,723.17	0.12

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	645,162,925.18
卖出股票收入（成交）总额	467,820,841.43

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
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）	2,840,430.37	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,840,430.37	0.07

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	118034	晶能转债	22,390	2,840,430.37	0.07
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	95,682.80
2	应收清算款	19,455,785.84
3	应收股利	301,395.88
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	79,509.63
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,932,374.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688111	金山办公	38,863,706.00	0.92	转融通出借证券受限
2	688036	传音控股	20,932,800.00	0.49	转融通出借证券受限
3	300760	迈瑞医疗	9,173,880.00	0.22	转融通出借证券受限
4	300750	宁德时代	8,053,408.00	0.19	转融通出借证券受限
5	300274	阳光电源	6,426,313.00	0.15	转融通出借证券受限
6	300122	智飞生物	4,700,670.00	0.11	转融通出借证券受限
7	300124	汇川技术	4,051,651.00	0.10	转融通出借证券受限
8	688981	中芯国际	3,359,580.00	0.08	转融通出借证券受限

9	300014	亿纬锂能	2,522,850.00	0.06	转融通出借证券受限
10	688012	中微公司	2,299,815.00	0.05	转融通出借证券受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏科创创业 50ETF 发起式联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
111,340	66,433.08	750,958,527.00	10.15%	5,708,780,611.00	77.18%	936,920,304.00	12.67%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	467,493,510.00	6.32%
2	魏小平	43,616,600.00	0.59%
3	华泰证券股份有限公司	43,569,959.00	0.59%
4	张治宇	40,000,000.00	0.54%
5	宋永	26,695,000.00	0.36%
6	方正证券股份有限公司	25,077,898.00	0.34%
7	凌志	22,563,586.00	0.31%
8	浙商证券股份有限公司	21,469,100.00	0.29%
9	光大证券资管—光大银行—光证资管诚享 62 号集合资产管理计划	20,349,500.00	0.28%
10	光大证券资管—光大银行—光证资管诚享 63 号集合资产管理计划	16,968,500.00	0.23%

11	中国银行股份有限公司— 华夏中证科创创业 50 交易 型开放式指数证券投资基金 发起式联接基金	936,920,304.00	12.67%
----	--	----------------	--------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	21,959.00	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 6 月 24 日）基金份额总额	3,000,059,442.00
本报告期期初基金份额总额	6,567,259,442.00
本报告期基金总申购份额	1,500,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	670,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,396,659,442.00

## §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	23	467,965,466.23	42.85%	201,835.50	42.84%	-
天风证券	1	256,112,697.47	23.45%	110,464.98	23.45%	-
中信建投证券	5	172,255,448.60	15.77%	74,294.49	15.77%	-
华泰证券	3	83,377,756.81	7.63%	35,961.60	7.63%	-
海通证券	5	61,361,426.10	5.62%	26,466.46	5.62%	-
方正证券	4	50,706,385.85	4.64%	21,869.91	4.64%	-
申万宏源证券	4	445,668.65	0.04%	192.19	0.04%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了北京高华证券、财通证券、长江证券、东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、广发证券、国金证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、华安证券、华西证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、太平洋证券、万和证券、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际、野村东方国际证券、银河证券、招商证券、浙商证券、中国银河证券、中金公司、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，财通证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
中信证券	1,639,390.46	14.42%	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	9,730,064.69	85.58%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

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

2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-19
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-24
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-03
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-11
6	华夏基金管理有限公司关于华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-14
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-23
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-01
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-13
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-15
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-27
13	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-13
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-27
15	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-31
16	华夏基金管理有限公司关于华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-08

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

#### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

#### 12.3 查阅方式

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

华夏基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日