

华泰柏瑞沪深 300 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：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 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 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	164
7.1 期末基金资产组合情况	164
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	164
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	166
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	175
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	176
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	176

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	177
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	177
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	177
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	177
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	177
7.12 投资组合报告附注	177
§ 8 基金份额持有人信息	179
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	179
8.2 期末上市基金前十名持有人	179
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	180
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	180
§ 9 开放式基金份额变动	180
§ 10 重大事件揭示	180
10.1 基金份额持有人大会决议	180
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	180
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	180
10.4 基金投资策略的改变	180
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	181
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	181
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	181
10.8 其他重大事件	184
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	185
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	185
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	185
§ 12 备查文件目录	185
12.1 备查文件目录	185
12.2 存放地点	185
12.3 查阅方式	185

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF
场内简称	300ETF(扩位证券简称: 沪深 300ETF)
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 4 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,521,587,690.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法, 即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时, 基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的实际投资组合, 追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金, 股票最低仓位为 95%, 并采用完全复制的被动式投资策略: 一方面, 相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言, 其风险和收益较高, 属于股票型基金中高风险、高收益的产品; 另一方面, 相对于采用抽样复制的指数型基金而言, 其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

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		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	郭明
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200135	100140

法定代表人	贾波	陈四清
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	70,815,633.71
本期利润	722,667,116.35
加权平均基金份额本期利润	0.0410
本期加权平均净值利润率	1.02%
本期基金份额净值增长率	0.14%
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	21,940,248,888.51
期末可供分配基金份额利润	1.1846
期末基金资产净值	71,870,505,399.32
期末基金份额净值	3.8804
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	70.16%

注：1、上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、本基金于 2012 年 5 月 11 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933。期末还原后基金份额累计净值=（期末基金份额净值+基金份额累计分红金额）×折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买沪深 300ETF 后的实际份额净值变动情况。

3.2 基金净值表现

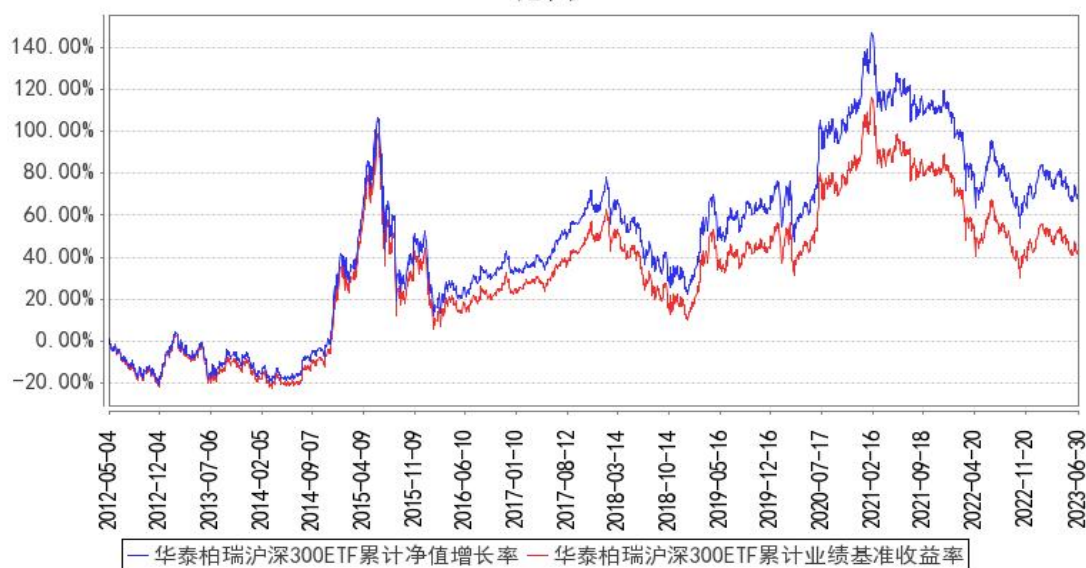
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	2.09%	0.86%	1.16%	0.87%	0.93%	-0.01%
过去三个月	-4.14%	0.83%	-5.15%	0.83%	1.01%	0.00%
过去六个月	0.14%	0.84%	-0.75%	0.84%	0.89%	0.00%
过去一年	-12.73%	0.98%	-14.33%	0.99%	1.60%	-0.01%
过去三年	-3.14%	1.19%	-7.72%	1.20%	4.58%	-0.01%
自基金合同生效起 至今	70.16%	1.38%	42.76%	1.39%	27.40%	-0.01%

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

华泰柏瑞沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2012 年 5 月 4 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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币

市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资

资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数

交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选6个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证香港300金融服务交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华泰柏瑞安盛一年持有期债券型证券投资基金、华泰柏瑞招享6个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金(QDII)、华泰柏瑞上证50指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞锦汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞轮动精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中央企业红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞致远混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至2023年6月30日,公司基金管理规模为3348.66亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳军	总经理助理、指数投资部总监、本基金的基金经理	2012年5月4日	—	22年	复旦大学财务管理硕士，2000-2001年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年7月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利ETF基金经理助理。2009年6月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010年10月起担任指数投资部副总监。2011年1月至2020年2月任华泰柏瑞上证中小盘ETF基金、华泰柏瑞上证中小盘ETF联接基金基金经理。2012年5月起任华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015年2月起任指数投资部总监。2015年5月起任华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018年3月至2018年11月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

					2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起任华泰柏瑞纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：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。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在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

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

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 5 次，其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 4 次为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

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

2023 年上半年市场以结构性机会为主，其中通信、传媒、计算机、机械设备的表现相对较好，涨跌幅分别为 50.66%、42.75%、27.57%和 13.44%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为-0.75%、2.29%、5.10%和-5.61%。从市场风格来看，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为 3.65%和-6.15%，中证 500 价值相对中证 500 成长获得了显著的超额收益。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投

资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.013%，期间日跟踪误差为 0.026%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.8804 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.14%，业绩比较基准收益率为-0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年以来，中国面临的内部和外部环境仍旧复杂多变，国内经济复苏斜率有所放缓，国内有效需求不足。在此背景下资本市场投资者预期也发生了较大的变化，前期市场已经注入较多悲观预期，甚至是一些较为长期的经济需转型的问题，放大了短期经济下行的压力，究其原因还是在于重新开放后对于中国经济增长中枢的判断。展望后市，国内主要市场主体都处于资产负债表修复阶段，政策组合陆续出台，市场风险偏好显著提振。建议关注政策友好期带来的顺周期行情，当前沪深 300 指数在一倍标准差下方，配置价值凸显。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。本报告期内，本基金符合分红条件，于 2023 年 1 月 16 日进行分配，每 10 份基金份额派发现金红利 0.64 元。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他

法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	537,725,236.60	155,603,662.35
结算备付金		781,124,184.13	1,179,756,245.63
存出保证金		113,461,873.91	113,458,113.95
交易性金融资产	6.4.7.2	70,549,881,747.77	76,183,605,477.34
其中：股票投资		70,549,881,747.77	76,183,605,477.34
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资	6.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—	—

应收清算款		21,031,027.60	2,829,488.24
应收股利		834,531.59	329,237.44
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	790,025.82	1,122,995.87
资产总计		72,004,848,627.42	77,636,705,220.82
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		286,554.44	30,652.12
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		53,378,198.85	53,830,041.48
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		28,742,079.11	30,555,976.07
应付托管费		5,748,415.81	6,111,195.25
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15.46	11.83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	46,187,964.43	43,674,118.72
负债合计		134,343,228.10	134,201,995.47
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	49,930,256,510.81	53,084,327,381.63
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	21,940,248,888.51	24,418,175,843.72
净资产合计		71,870,505,399.32	77,502,503,225.35
负债和净资产总计		72,004,848,627.42	77,636,705,220.82

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.8804 元，基金份额总额 18,521,587,690.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		945,605,057.85	-4,200,775,137.18
1. 利息收入		31,573,133.03	30,250,214.19

其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,225,668.62	7,988,070.49
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		24,347,464.41	22,262,143.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		241,391,012.99	-4,818,040,052.30
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-504,503,668.42	-5,085,405,710.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,191,438.70	7,182,991.14
资产支持证券 投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-23,712,340.06	-188,225,527.28
股利收益	6.4.7.19	766,415,582.77	448,408,194.35
以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	6.4.7.20	651,851,482.64	588,088,290.43
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.21	20,789,429.19	-1,073,589.50
减：二、营业总支出		222,937,941.50	156,380,984.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	176,652,571.62	123,970,021.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,330,514.33	24,794,004.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资 产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		17,915.29	29.51
8. 其他费用	6.4.7.23	10,936,940.26	7,616,928.47
三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）		722,667,116.35	-4,357,156,121.34
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		722,667,116.35	-4,357,156,121.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		722,667,116.35	-4,357,156,121.34

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	53,084,327,381.63	-	24,418,175,843.72	77,502,503,225.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	53,084,327,381.63	-	24,418,175,843.72	77,502,503,225.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,154,070,870.82	-	-2,477,926,955.21	-5,631,997,826.03
（一）、综合收益总额	-	-	722,667,116.35	722,667,116.35
（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）	-3,154,070,870.82	-	-2,007,378,860.01	-5,161,449,730.83
其中：1. 基金申购款	26,559,702,899.13	-	13,032,253,597.03	39,591,956,496.16
2. 基金赎回款	-29,713,773,769.95	-	-15,039,632,457.04	-44,753,406,226.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-1,193,215,211.55	-1,193,215,211.55

金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	49,930,256,510.81	-	21,940,248,888.51	71,870,505,399.32
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	30,571,540,020.08	-	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	30,571,540,020.08	-	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,463,003,637.84	-	-6,656,851,633.84	-8,119,855,271.68
（一）、综合收益总额	-	-	-4,357,156,121.34	-4,357,156,121.34
（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）	-1,463,003,637.84	-	-1,436,131,430.35	-2,899,135,068.19
其中：1. 基金申购款	33,717,017,554.05	-	19,467,252,514.58	53,184,270,068.63
2. 基金赎回款	-35,180,021,191.89	-	-20,903,383,944.93	-56,083,405,136.82
（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	-	-	-863,564,082.15	-863,564,082.15

值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	29,108,536,382.24	-	19,657,667,583.54	48,766,203,965.78

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：

韩勇
基金管理人负责人

房伟力
主管会计工作负责人

赵景云
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 32,967,336,606.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 121 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 32,968,633,875.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,297,269.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2012 年 5 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933，并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2012]14 号文审核同意，本基金 12,229,687,690.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资

基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数沪深 300 指数成份股、备选成份股为主要投资对象；此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（一级市场初次发行或增发）、存托凭证、债券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资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 95%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度（剔除成份股分红因素）的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2012 年 5 月 29 日募集成立了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”）。华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2023 年 8 月 31 日批准报出。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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”）、中国证监会颁布的《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〉》、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》、《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本基金 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[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[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《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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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) 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人

所得税。

(4) 基金卖出股票按 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	537,725,236.60
等于：本金	537,680,000.37
加：应计利息	45,236.23
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	537,725,236.60

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	74,474,405,857.05	—	70,549,881,747.77	-3,924,524,109.28
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—

其他	-	-	-	-
合计	74,474,405,857.05	-	70,549,881,747.77	-3,924,524,109.28

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	887,854,860.00	-	-	
其中：股指期货投资	887,854,860.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	887,854,860.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2307	沪深 300 期货 2307	270.00	310,262,400.00	-285,480.00
IF2309	沪深 300 期货 2309	500.00	575,850,000.00	-1,456,980.00
合计				-1,742,460.00
减：可抵销期货 暂收款				-1,742,460.00
净额				0.00

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 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	790,025.82
待摊费用	—
合计	790,025.82

6.4.7.9 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	3,268,308.12
其中：交易所市场	3,268,308.12
银行间市场	—

应付利息	-
预提费用	184,850.17
应付指数使用费	10,599,154.30
其他应付款	500,000.00
应退退补款	31,635,651.84
合计	46,187,964.43

6.4.7.10 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	19,691,587,690.00	53,084,327,381.63
本期申购	9,852,300,000.00	26,559,702,899.13
本期赎回（以“-”号填列）	-11,022,300,000.00	-29,713,773,769.95
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	18,521,587,690.00	49,930,256,510.81

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末未有其他综合收益。

6.4.7.12 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	64,973,333,076.08	-40,555,157,232.36	24,418,175,843.72
本期利润	70,815,633.71	651,851,482.64	722,667,116.35
本期基金份额交易产生的变动数	-3,868,860,395.69	1,861,481,535.68	-2,007,378,860.01
其中：基金申购款	31,769,766,074.07	-18,737,512,477.04	13,032,253,597.03
基金赎回款	-35,638,626,469.76	20,598,994,012.72	-15,039,632,457.04
本期已分配利润	-1,193,215,211.55	-	-1,193,215,211.55
本期末	59,982,073,102.55	-38,041,824,214.04	21,940,248,888.51

6.4.7.13 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	489,570.60
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	6,681,161.15

其他	54,936.87
合计	7,225,668.62

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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	-646,019,600.89
股票投资收益——赎回差价收入	141,515,932.47
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	-504,503,668.42

6.4.7.14.2 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	21,788,462,125.76
减：卖出股票成本总额	22,402,809,216.35
减：交易费用	31,672,510.30
买卖股票差价收入	-646,019,600.89

6.4.7.14.3 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	44,753,406,226.99
减：现金支付赎回款总额	19,340,192,439.99
减：赎回股票成本总额	25,271,697,854.53
减：交易费用	-
赎回差价收入	141,515,932.47

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 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	4,156.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,187,281.84
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	3,191,438.70

6.4.7.15.2 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	21,526,024.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,333,600.00
减：应计利息总额	4,281.54
减：交易费用	861.14
买卖债券差价收入	3,187,281.84

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-23,712,340.06

6.4.7.19 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	766,415,582.77
其中：证券出借权益补偿收入	11,610,531.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	766,415,582.77

6.4.7.20 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	637,176,202.64
股票投资	637,176,202.64
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	14,675,280.00
权证投资	-
期货投资	14,675,280.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动	-

产生的预估增值税	
合计	651,851,482.64

6.4.7.21 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	20,747,693.24
其他	41,735.95
合计	20,789,429.19

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 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	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	10,599,154.30
注册登记费	200,959.04
银行划款手续费	2,935.79
合计	10,936,940.26

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

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 （%）
华泰证券	-	-	12,431,878,258.66	24.83

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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（%）
—	—	—	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
华泰证券	1,699,651.56	25.12	1,699,651.56	43.63

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

6.4.10.2 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	176,652,571.62	123,970,021.84
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的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。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

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	35,330,514.33	24,794,004.34

注：支付基金托管人中国工商银行的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。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	6,347,746,486.00	5,097,352.61	195,578,475.00	67,583.40
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	7,845,376,637.00	5,641,863.42	424,087,545.60	220,029.04

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
华泰证券	202306060002650	TCL 科技	2023 年 6 月 6 日	1,291,240.00	339,800	14	3.20	1,606.92	-	-
华泰证券	2023060700002497	TCL 科技	2023 年 6 月 7 日	1,032,576.00	268,900	14	3.20	1,284.92	-	-
华泰证券	2023060800002344	TCL 科技	2023 年 6 月 8 日	1,930,000.00	500,000	14	3.40	3,281.04	-	-
华泰证券	2023061200022672	TCL 科技	2023 年 6 月 12 日	3,870,000.00	1,000,000	14	3.20	4,816.00	-	-
华泰证券	2023061300002597	TCL 科技	2023 年 6 月 13 日	1,515,648.00	394,700	14	3.20	1,886.08	-	-
华泰证券	2023061400016373	TCL 科技	2023 年 6 月 14 日	770,000.00	200,000	14	3.20	958.16	-	-

华泰证券	20230619000 01068	TCL 科技	2023 年 6 月 19 日	1,955,000.00	500,000	14	3.20	1,911.58	1,970,000.00	1,911.58
华泰证券	20230620000 10306	TCL 科技	2023 年 6 月 20 日	780,000.00	200,000	14	3.20	693.30	788,000.00	693.30
华泰证券	20230620000 33659	TCL 科技	2023 年 6 月 20 日	1,325,220.00	339,800	14	3.20	1,178.00	1,338,812.00	1,178.00
华泰证券	20230621000 01970	TCL 科技	2023 年 6 月 21 日	562,737.00	147,700	14	3.20	450.18	581,938.00	450.18
华泰证券	20230621000 14977	TCL 科技	2023 年 6 月 21 日	1,024,509.00	268,900	14	3.20	819.63	1,059,466.00	819.63
华泰证券	20230626000 01433	TCL 科技	2023 年 6 月 26 日	378,000.00	100,000	14	3.20	134.40	394,000.00	134.40
华泰证券	20230626000 35720	TCL 科技	2023 年 6 月 26 日	1,890,000.00	500,000	14	3.40	714.00	1,970,000.00	714.00
华泰证券	20230626000 41525	TCL 科技	2023 年 6 月 26 日	3,780,000.00	1,000,000	14	3.20	1,344.00	3,940,000.00	1,344.00
华泰证券	20230627000 21284	TCL 科技	2023 年 6 月 27 日	1,484,072.00	394,700	14	3.20	395.76	1,555,118.00	395.76
华泰证券	20230628000 52175	TCL 科技	2023 年 6 月 28 日	768,000.00	200,000	14	3.20	136.54	788,000.00	136.54
华泰证券	20230515000 01541	TCL 中环	2023 年 5 月 15 日	3,772,848.00	94,700	14	3.20	4,695.04	-	-
华泰证券	20230516000 01278	TCL 中环	2023 年 5 月 16 日	3,955,896.00	98,700	14	3.20	4,922.96	-	-
华泰证券	20230529000 01401	TCL 中环	2023 年 5 月 29 日	29,918,798.00	764,600	14	3.20	37,232.30	-	-
华泰证券	20230529000 11086	TCL 中环	2023 年 5 月 29 日	3,705,611.00	94,700	14	3.20	4,611.46	-	-
华泰证券	20230530000 20866	TCL 中环	2023 年 5 月 30 日	3,767,379.00	98,700	14	3.20	4,688.32	-	-
华泰证券	20230612000 39738	TCL 中环	2023 年 6 月 12 日	28,221,386.00	764,600	14	3.20	35,119.98	-	-
华泰证券	20230613000 21345	TCL 中环	2023 年 6 月 13 日	3,638,082.00	98,700	14	3.20	4,527.46	-	-
华泰证券	20230627000 16475	TCL 中环	2023 年 6 月 27 日	3,163,335.00	98,700	14	3.20	843.57	3,276,840.00	843.57
华泰证券	20230113000 08436	爱尔眼科	2023 年 1 月 13 日	6,995,602.00	207,400	14	3.40	11,231.90	-	-
华泰证券	20230104000 15050	爱尔眼科	2023 年 1 月 4 日	2,949,309.00	96,100	28	3.40	7,799.40	-	-
华泰证券	20230130000 88893	爱尔眼科	2023 年 1 月 30 日	6,966,566.00	207,400	14	3.40	9,211.30	-	-
华泰证券	20230209000	爱尔眼科	2023 年 2 月 9	6,168,390.00	190,500	14	3.40	8,155.98	-	-

	00521		日							
华泰证券	20230210000 00939	爱尔眼科	2023 年 2 月 10 日	6,536,300.00	200,500	14	3.40	8,642.48	-	-
华泰证券	20230213000 82902	爱尔眼科	2023 年 2 月 13 日	6,858,718.00	207,400	14	3.40	9,068.78	-	-
华泰证券	20230223000 00558	爱尔眼科	2023 年 2 月 23 日	157,650.00	5,000	14	3.40	208.46	-	-
华泰证券	20230227000 64248	爱尔眼科	2023 年 2 月 27 日	6,445,992.00	207,400	14	3.40	8,523.06	-	-
华泰证券	20230309000 06514	爱尔眼科	2023 年 3 月 9 日	150,600.00	5,000	14	3.40	199.08	-	-
华泰证券	20230313000 63080	爱尔眼科	2023 年 3 月 13 日	6,375,476.00	207,400	14	3.40	8,429.82	-	-
华泰证券	20230323000 07008	爱尔眼科	2023 年 3 月 23 日	153,500.00	5,000	14	3.40	203.00	-	-
华泰证券	20230327000 69979	爱尔眼科	2023 年 3 月 27 日	6,344,366.00	207,400	14	3.40	8,388.66	-	-
华泰证券	20230406000 13016	爱尔眼科	2023 年 4 月 6 日	148,400.00	5,000	14	3.40	196.28	-	-
华泰证券	20230410000 64987	爱尔眼科	2023 年 4 月 10 日	6,450,140.00	207,400	14	3.40	8,528.52	-	-
华泰证券	20230420000 09135	爱尔眼科	2023 年 4 月 20 日	146,850.00	5,000	14	3.40	194.18	-	-
华泰证券	20230424000 61661	爱尔眼科	2023 年 4 月 24 日	5,830,014.00	207,400	14	3.40	7,708.54	-	-
华泰证券	20230504000 34039	爱尔眼科	2023 年 5 月 4 日	144,950.00	5,000	14	3.40	191.66	-	-
华泰证券	20230508000 62583	爱尔眼科	2023 年 5 月 8 日	6,016,674.00	207,400	14	3.40	7,955.36	-	-
华泰证券	20230518000 40818	爱尔眼科	2023 年 5 月 18 日	147,450.00	5,000	14	3.40	195.02	-	-
华泰证券	20230522000 54318	爱尔眼科	2023 年 5 月 22 日	6,226,148.00	207,400	14	3.40	8,232.42	-	-
华泰证券	20230601000 25606	爱尔眼科	2023 年 6 月 1 日	136,150.00	5,000	14	3.40	180.04	-	-
华泰证券	20230605000 29690	爱尔眼科	2023 年 6 月 5 日	5,651,650.00	207,400	14	3.40	7,472.78	-	-
华泰证券	20230615000 35333	爱尔眼科	2023 年 6 月 15 日	102,450.00	5,000	14	3.40	135.52	-	-
华泰证券	20230629000 31262	爱尔眼科	2023 年 6 月 29 日	92,800.00	5,000	14	3.40	8.76	92,750.00	8.76
华泰证券	20230103000 26097	爱美客	2023 年 1 月 3 日	6,000,804.00	10,800	14	3.40	7,934.36	-	-

华泰证券	20230117000 22203	爱美客	2023 年 1 月 17 日	6,796,440.00	10,800	14	3.40	8,986.46	-	-
华泰证券	20230525000 02835	爱美客	2023 年 5 月 25 日	4,757,600.00	10,000	14	3.40	6,290.62	-	-
华泰证券	20230530000 16204	宝钢股份	2023 年 5 月 30 日	220,662.00	36,900	7	1.80	77.21	-	-
华泰证券	20230529000 01373	宝钢股份	2023 年 5 月 29 日	464,310.00	77,000	14	1.80	325.08	-	-
华泰证券	20230529000 01429	宝钢股份	2023 年 5 月 29 日	2,436,120.00	404,000	14	1.80	1,705.34	-	-
华泰证券	20230606000 16705	宝钢股份	2023 年 6 月 6 日	217,710.00	36,900	7	1.80	76.23	-	-
华泰证券	20230613000 20806	宝钢股份	2023 年 6 月 13 日	214,758.00	36,900	7	1.80	75.18	-	-
华泰证券	20230612000 22908	宝钢股份	2023 年 6 月 12 日	2,367,440.00	404,000	14	1.80	1,657.18	-	-
华泰证券	20230620000 10307	宝钢股份	2023 年 6 月 20 日	206,271.00	36,900	7	1.80	72.17	-	-
华泰证券	20230627000 21489	宝钢股份	2023 年 6 月 27 日	207,378.00	36,900	7	1.80	31.11	207,378.00	31.11
华泰证券	20230626000 31784	宝钢股份	2023 年 6 月 26 日	2,222,000.00	404,000	14	1.80	444.40	2,270,480.00	444.40
华泰证券	20230522000 01221	宝信软件	2023 年 5 月 22 日	338,240.00	6,400	14	3.20	420.98	-	-
华泰证券	20230605000 21276	宝信软件	2023 年 6 月 5 日	339,904.00	6,400	14	3.20	422.94	-	-
华泰证券	20230619000 24433	宝信软件	2023 年 6 月 19 日	348,928.00	6,400	14	3.20	341.22	325,184.00	341.22
华泰证券	20230530000 16192	保利发展	2023 年 5 月 30 日	255,115.00	19,700	7	1.80	89.32	-	-
华泰证券	20230529000 01350	保利发展	2023 年 5 月 29 日	271,740.00	21,000	14	1.80	190.26	-	-
华泰证券	20230529000 01351	保利发展	2023 年 5 月 29 日	841,100.00	65,000	14	1.80	588.84	-	-
华泰证券	20230606000 17999	保利发展	2023 年 6 月 6 日	266,541.00	19,700	7	1.80	93.31	-	-
华泰证券	20230613000 19758	保利发展	2023 年 6 月 13 日	267,329.00	19,700	7	1.80	93.59	-	-
华泰证券	20230612000 23169	保利发展	2023 年 6 月 12 日	873,600.00	65,000	14	1.80	611.52	-	-
华泰证券	20230620000 10318	保利发展	2023 年 6 月 20 日	259,055.00	19,700	7	1.80	90.65	-	-
华泰证券	20230627000	保利发展	2023 年 6 月	264,571.00	19,700	7	1.80	39.69	256,691.00	39.69

	21963		27 日							
华泰证券	20230626000 34943	保利发展	2023 年 6 月 26 日	846,300.00	65,000	14	1.80	169.28	846,950.00	169.28
华泰证券	20230606000 02653	北方稀土	2023 年 6 月 6 日	75,200.00	3,200	14	3.20	93.52	-	-
华泰证券	20230607000 02537	北方稀土	2023 年 6 月 7 日	93,680.00	4,000	14	3.20	116.62	-	-
华泰证券	20230223000 00569	北京君正	2023 年 2 月 23 日	384,500.00	5,000	14	3.40	508.34	-	-
华泰证券	20230309000 06510	北京君正	2023 年 3 月 9 日	379,400.00	5,000	14	3.40	501.62	-	-
华泰证券	20230323000 06998	北京君正	2023 年 3 月 23 日	426,800.00	5,000	14	3.40	564.34	-	-
华泰证券	20230406000 13026	北京君正	2023 年 4 月 6 日	546,900.00	5,000	14	3.40	723.10	-	-
华泰证券	20230420000 12487	北京君正	2023 年 4 月 20 日	527,400.00	5,000	14	3.40	697.34	-	-
华泰证券	20230504000 24165	北京君正	2023 年 5 月 4 日	420,250.00	5,000	14	3.40	555.66	-	-
华泰证券	20230518000 40278	北京君正	2023 年 5 月 18 日	421,350.00	5,000	14	3.40	557.06	-	-
华泰证券	20230601000 25063	北京君正	2023 年 6 月 1 日	460,300.00	5,000	14	3.40	608.58	-	-
华泰证券	20230615000 33011	北京君正	2023 年 6 月 15 日	457,000.00	5,000	14	3.40	604.24	-	-
华泰证券	20230629000 45165	北京君正	2023 年 6 月 29 日	441,250.00	5,000	14	3.40	41.67	441,550.00	41.67
华泰证券	20230517000 01762	北新建材	2023 年 5 月 17 日	39,680.00	1,600	14	3.20	49.42	-	-
华泰证券	20230531000 08845	北新建材	2023 年 5 月 31 日	36,368.00	1,600	14	3.20	45.22	-	-
华泰证券	20230613000 02593	北新建材	2023 年 6 月 13 日	50,300.00	2,000	14	3.20	62.58	-	-
华泰证券	20230103000 00728	贝泰妮	2023 年 1 月 3 日	585,600.00	4,000	14	3.40	774.34	-	-
华泰证券	20230103000 28105	贝泰妮	2023 年 1 月 3 日	4,684,800.00	32,000	14	3.40	6,194.30	-	-
华泰证券	20230104000 00762	贝泰妮	2023 年 1 月 4 日	147,570.00	1,000	14	3.40	195.16	-	-
华泰证券	20230105000 00744	贝泰妮	2023 年 1 月 5 日	150,360.00	1,000	14	3.40	198.80	-	-
华泰证券	20230109000 37468	贝泰妮	2023 年 1 月 9 日	437,730.00	3,000	14	3.40	868.14	-	-

华泰证券	2023010900037600	贝泰妮	2023 年 1 月 9 日	4,523,210.00	31,000	14	3.40	8,970.99	-	-
华泰证券	2023011000017259	贝泰妮	2023 年 1 月 10 日	585,200.00	4,000	14	3.40	1,105.40	-	-
华泰证券	2023011100000219	贝泰妮	2023 年 1 月 11 日	1,851,980.00	13,000	14	3.40	3,323.29	-	-
华泰证券	2023011700022163	贝泰妮	2023 年 1 月 17 日	4,589,120.00	32,000	14	3.40	6,067.88	-	-
华泰证券	2023011700022289	贝泰妮	2023 年 1 月 17 日	573,640.00	4,000	14	3.40	758.52	-	-
华泰证券	2023011800016983	贝泰妮	2023 年 1 月 18 日	139,900.00	1,000	14	3.40	184.94	-	-
华泰证券	2023011900013462	贝泰妮	2023 年 1 月 19 日	140,000.00	1,000	14	3.40	185.08	-	-
华泰证券	2023012000000230	贝泰妮	2023 年 1 月 20 日	138,990.00	1,000	14	3.40	183.82	-	-
华泰证券	2023013000072037	贝泰妮	2023 年 1 月 30 日	1,836,120.00	13,000	14	3.40	2,427.74	-	-
华泰证券	2023013000072131	贝泰妮	2023 年 1 月 30 日	4,378,440.00	31,000	14	3.40	5,789.28	-	-
华泰证券	2023013000072135	贝泰妮	2023 年 1 月 30 日	423,720.00	3,000	14	3.40	560.28	-	-
华泰证券	2023013000074333	贝泰妮	2023 年 1 月 30 日	564,960.00	4,000	14	3.40	747.04	-	-
华泰证券	2023013100032239	贝泰妮	2023 年 1 月 31 日	4,477,120.00	32,000	14	3.40	5,919.76	-	-
华泰证券	2023013100032241	贝泰妮	2023 年 1 月 31 日	559,640.00	4,000	14	3.40	740.04	-	-
华泰证券	2023020100018044	贝泰妮	2023 年 2 月 1 日	141,500.00	1,000	14	3.40	187.04	-	-
华泰证券	2023020200014409	贝泰妮	2023 年 2 月 2 日	139,470.00	1,000	14	3.40	184.38	-	-
华泰证券	2023021300079398	贝泰妮	2023 年 2 月 13 日	1,893,320.00	13,000	14	3.40	2,503.34	-	-
华泰证券	2023021300082794	贝泰妮	2023 年 2 月 13 日	582,560.00	4,000	14	3.40	770.28	-	-
华泰证券	2023021300082918	贝泰妮	2023 年 2 月 13 日	4,514,840.00	31,000	14	3.40	5,969.60	-	-
华泰证券	2023021300082920	贝泰妮	2023 年 2 月 13 日	436,920.00	3,000	14	3.40	577.78	-	-
华泰证券	2023021400024621	贝泰妮	2023 年 2 月 14 日	4,683,840.00	32,000	14	3.40	6,193.04	-	-
华泰证券	20230214000	贝泰妮	2023 年 2 月	585,480.00	4,000	14	3.40	774.20	-	-

	24623		14 日							
华泰证券	20230215000 15380	贝泰妮	2023 年 2 月 15 日	145,880.00	1,000	14	3.40	192.92	-	-
华泰证券	20230216000 13683	贝泰妮	2023 年 2 月 16 日	142,000.00	1,000	14	3.40	187.74	-	-
华泰证券	20230227000 66152	贝泰妮	2023 年 2 月 27 日	535,520.00	4,000	14	3.40	708.12	-	-
华泰证券	20230227000 68014	贝泰妮	2023 年 2 月 27 日	401,640.00	3,000	14	3.40	531.02	-	-
华泰证券	20230227000 74088	贝泰妮	2023 年 2 月 27 日	4,150,280.00	31,000	14	3.40	5,487.58	-	-
华泰证券	20230227000 74238	贝泰妮	2023 年 2 月 27 日	1,740,440.00	13,000	14	3.40	2,301.32	-	-
华泰证券	20230228000 26522	贝泰妮	2023 年 2 月 28 日	4,432,000.00	32,000	14	3.40	5,860.12	-	-
华泰证券	20230228000 26524	贝泰妮	2023 年 2 月 28 日	554,000.00	4,000	14	3.40	732.48	-	-
华泰证券	20230301000 18485	贝泰妮	2023 年 3 月 1 日	137,880.00	1,000	14	3.40	182.28	-	-
华泰证券	20230302000 11833	贝泰妮	2023 年 3 月 2 日	139,940.00	1,000	14	3.40	185.08	-	-
华泰证券	20230313000 68932	贝泰妮	2023 年 3 月 13 日	352,860.00	3,000	14	3.40	466.62	-	-
华泰证券	20230313000 68958	贝泰妮	2023 年 3 月 13 日	3,646,220.00	31,000	14	3.40	4,821.18	-	-
华泰证券	20230313000 68968	贝泰妮	2023 年 3 月 13 日	470,480.00	4,000	14	3.40	622.02	-	-
华泰证券	20230313000 68974	贝泰妮	2023 年 3 月 13 日	1,529,060.00	13,000	14	3.40	2,021.74	-	-
华泰证券	20230314000 19510	贝泰妮	2023 年 3 月 14 日	481,560.00	4,000	14	3.40	636.72	-	-
华泰证券	20230314000 19626	贝泰妮	2023 年 3 月 14 日	3,852,480.00	32,000	14	3.40	5,093.90	-	-
华泰证券	20230315000 15693	贝泰妮	2023 年 3 月 15 日	120,000.00	1,000	14	3.40	158.62	-	-
华泰证券	20230316000 13416	贝泰妮	2023 年 3 月 16 日	120,550.00	1,000	14	3.40	159.46	-	-
华泰证券	20230327000 69529	贝泰妮	2023 年 3 月 27 日	3,633,510.00	31,000	14	3.40	4,804.38	-	-
华泰证券	20230327000 69545	贝泰妮	2023 年 3 月 27 日	468,840.00	4,000	14	3.40	619.92	-	-
华泰证券	20230327000 69917	贝泰妮	2023 年 3 月 27 日	1,523,730.00	13,000	14	3.40	2,014.74	-	-

华泰证券	2023032700070043	贝泰妮	2023 年 3 月 27 日	351,630.00	3,000	14	3.40	464.94	-	-
华泰证券	2023032800023959	贝泰妮	2023 年 3 月 28 日	479,600.00	4,000	14	3.40	634.20	-	-
华泰证券	2023032800023961	贝泰妮	2023 年 3 月 28 日	3,836,800.00	32,000	14	3.40	5,073.04	-	-
华泰证券	2023032900016872	贝泰妮	2023 年 3 月 29 日	120,600.00	1,000	14	3.40	159.46	-	-
华泰证券	2023033000017459	贝泰妮	2023 年 3 月 30 日	127,370.00	1,000	14	3.40	168.42	-	-
华泰证券	2023041000059431	贝泰妮	2023 年 4 月 10 日	1,657,110.00	13,000	14	3.40	2,191.14	-	-
华泰证券	2023041000061815	贝泰妮	2023 年 4 月 10 日	509,880.00	4,000	14	3.40	674.24	-	-
华泰证券	2023041000061939	贝泰妮	2023 年 4 月 10 日	3,951,570.00	31,000	14	3.40	5,224.80	-	-
华泰证券	2023041000064817	贝泰妮	2023 年 4 月 10 日	382,410.00	3,000	14	3.40	505.68	-	-
华泰证券	2023041100017762	贝泰妮	2023 年 4 月 11 日	509,480.00	4,000	14	3.40	673.68	-	-
华泰证券	2023041100017764	贝泰妮	2023 年 4 月 11 日	4,075,840.00	32,000	14	3.40	5,389.16	-	-
华泰证券	2023041200031194	贝泰妮	2023 年 4 月 12 日	123,200.00	1,000	14	3.40	162.96	-	-
华泰证券	2023041300012171	贝泰妮	2023 年 4 月 13 日	124,460.00	1,000	14	3.40	164.50	-	-
华泰证券	2023042400037833	贝泰妮	2023 年 4 月 24 日	441,360.00	4,000	14	3.40	583.52	-	-
华泰证券	2023042400037903	贝泰妮	2023 年 4 月 24 日	331,020.00	3,000	14	3.40	437.64	-	-
华泰证券	2023042400052385	贝泰妮	2023 年 4 月 24 日	3,420,540.00	31,000	14	3.40	4,522.70	-	-
华泰证券	2023042400061047	贝泰妮	2023 年 4 月 24 日	1,434,420.00	13,000	14	3.40	1,896.58	-	-
华泰证券	2023042500058995	贝泰妮	2023 年 4 月 25 日	431,640.00	4,000	14	3.40	570.78	-	-
华泰证券	2023042500058997	贝泰妮	2023 年 4 月 25 日	3,453,120.00	32,000	14	3.40	4,565.82	-	-
华泰证券	2023042600028360	贝泰妮	2023 年 4 月 26 日	108,020.00	1,000	14	3.40	142.80	-	-
华泰证券	2023042700021194	贝泰妮	2023 年 4 月 27 日	116,000.00	1,000	14	3.40	153.44	-	-
华泰证券	20230508000	贝泰妮	2023 年 5 月 8 日	3,421,160.00	31,000	14	3.40	4,523.54	-	-

	11789		日							
华泰证券	20230508000 21195	贝泰妮	2023年5月8 日	1,434,680.00	13,000	14	3.40	1,897.00	-	-
华泰证券	20230508000 44297	贝泰妮	2023年5月8 日	331,080.00	3,000	14	3.40	437.78	-	-
华泰证券	20230508000 56399	贝泰妮	2023年5月8 日	441,440.00	4,000	14	3.40	583.66	-	-
华泰证券	20230509000 14919	贝泰妮	2023年5月9 日	427,960.00	4,000	14	3.40	565.88	-	-
华泰证券	20230509000 14921	贝泰妮	2023年5月9 日	3,423,680.00	32,000	14	3.40	4,526.90	-	-
华泰证券	20230510000 28090	贝泰妮	2023年5月 10日	106,260.00	1,000	14	3.40	140.56	-	-
华泰证券	20230511000 10205	贝泰妮	2023年5月 11日	110,200.00	1,000	14	3.40	145.74	-	-
华泰证券	20230522000 35418	贝泰妮	2023年5月 22日	3,282,590.00	31,000	14	3.40	4,340.28	-	-
华泰证券	20230522000 36008	贝泰妮	2023年5月 22日	423,560.00	4,000	14	3.40	560.00	-	-
华泰证券	20230522000 36724	贝泰妮	2023年5月 22日	317,670.00	3,000	14	3.40	420.00	-	-
华泰证券	20230522000 58002	贝泰妮	2023年5月 22日	1,376,570.00	13,000	14	3.40	1,820.14	-	-
华泰证券	20230523000 08182	贝泰妮	2023年5月 23日	419,200.00	4,000	14	3.40	554.26	-	-
华泰证券	20230523000 08184	贝泰妮	2023年5月 23日	3,353,600.00	32,000	14	3.40	4,434.22	-	-
华泰证券	20230524000 20176	贝泰妮	2023年5月 24日	103,300.00	1,000	14	3.40	136.64	-	-
华泰证券	20230525000 06612	贝泰妮	2023年5月 25日	102,780.00	1,000	14	3.40	135.94	-	-
华泰证券	20230605000 23065	贝泰妮	2023年6月5 日	1,199,640.00	13,000	14	3.40	1,586.20	-	-
华泰证券	20230605000 26463	贝泰妮	2023年6月5 日	369,120.00	4,000	14	3.40	488.04	-	-
华泰证券	20230605000 29972	贝泰妮	2023年6月5 日	276,840.00	3,000	14	3.40	366.10	-	-
华泰证券	20230606000 18011	贝泰妮	2023年6月6 日	362,520.00	4,000	14	3.40	479.36	-	-
华泰证券	20230607000 02491	贝泰妮	2023年6月7 日	97,350.00	1,100	14	3.40	128.66	-	-
华泰证券	20230607000 24932	贝泰妮	2023年6月7 日	88,500.00	1,000	14	3.40	117.04	-	-

华泰证券	20230608000 02320	贝泰妮	2023 年 6 月 8 日	95,568.00	1,100	14	3.40	162.54	-	-
华泰证券	20230608000 18933	贝泰妮	2023 年 6 月 8 日	86,880.00	1,000	14	3.40	147.78	-	-
华泰证券	20230612000 22608	贝泰妮	2023 年 6 月 12 日	455,000.00	5,000	14	3.40	601.58	-	-
华泰证券	20230619000 24361	贝泰妮	2023 年 6 月 19 日	1,247,090.00	13,000	14	3.40	1,295.58	1,155,440.00	1,295.58
华泰证券	20230620000 10255	贝泰妮	2023 年 6 月 20 日	565,560.00	6,000	14	3.40	534.10	533,280.00	534.10
华泰证券	20230620000 35928	贝泰妮	2023 年 6 月 20 日	377,040.00	4,000	14	3.40	356.10	355,520.00	356.10
华泰证券	20230621000 18257	贝泰妮	2023 年 6 月 21 日	91,590.00	1,000	14	3.40	77.85	88,880.00	77.85
华泰证券	20230626000 01459	贝泰妮	2023 年 6 月 26 日	99,099.00	1,100	14	3.40	37.44	97,768.00	37.44
华泰证券	20230626000 47567	贝泰妮	2023 年 6 月 26 日	90,090.00	1,000	14	3.40	34.04	88,880.00	34.04
华泰证券	20230627000 04528	贝泰妮	2023 年 6 月 27 日	547,048.00	6,100	14	3.40	155.01	542,168.00	155.01
华泰证券	20230518000 01284	藏格矿业	2023 年 5 月 18 日	25,773.00	1,100	14	3.20	32.06	-	-
华泰证券	20230601000 01686	藏格矿业	2023 年 6 月 1 日	34,530.00	1,500	14	3.20	42.98	-	-
华泰证券	20230601000 22475	藏格矿业	2023 年 6 月 1 日	25,322.00	1,100	14	3.20	31.50	-	-
华泰证券	20230615000 27467	藏格矿业	2023 年 6 月 15 日	35,295.00	1,500	14	3.20	43.96	-	-
华泰证券	20230615000 37453	藏格矿业	2023 年 6 月 15 日	25,883.00	1,100	14	3.20	32.20	-	-
华泰证券	20230619000 01081	藏格矿业	2023 年 6 月 19 日	608,784.00	26,400	14	3.20	595.21	595,848.00	595.21
华泰证券	20230628000 04430	晨光股份	2023 年 6 月 28 日	638,166.00	14,100	14	3.20	113.46	629,424.00	113.46
华泰证券	20230103000 26169	传音控股	2023 年 1 月 3 日	2,338,400.00	29,600	14	3.40	3,091.90	-	-
华泰证券	20230117000 32207	传音控股	2023 年 1 月 17 日	2,510,080.00	29,600	14	3.40	3,318.84	-	-
华泰证券	20230131000 27095	传音控股	2023 年 1 月 31 日	2,531,688.00	29,600	14	3.40	3,347.40	-	-
华泰证券	20230214000 23929	传音控股	2023 年 2 月 14 日	2,609,536.00	29,600	14	3.40	3,450.44	-	-
华泰证券	20230517000	传音控股	2023 年 5 月	1,739,000.00	14,800	14	3.40	2,299.36	-	-

	01723		17 日							
华泰证券	20230516000 01288	传音控股	2023 年 5 月 16 日	431,730.00	3,900	28	3.40	1,141.56	-	-
华泰证券	20230531000 09387	传音控股	2023 年 5 月 31 日	1,861,100.00	14,800	14	3.40	2,460.78	-	-
华泰证券	20230614000 50735	传音控股	2023 年 6 月 14 日	1,934,064.00	14,800	14	3.40	2,557.24	-	-
华泰证券	20230613000 18694	传音控股	2023 年 6 月 13 日	514,332.00	3,900	28	3.40	825.86	573,300.00	825.86
华泰证券	20230628000 53057	传音控股	2023 年 6 月 28 日	2,072,000.00	14,800	14	3.40	391.38	2,175,600.00	391.38
华泰证券	20230426000 01616	春秋航空	2023 年 4 月 26 日	1,559,480.00	26,000	14	3.20	1,940.68	-	-
华泰证券	20230510000 07886	春秋航空	2023 年 5 月 10 日	1,504,100.00	26,000	14	3.20	1,871.80	-	-
华泰证券	20230524000 15282	春秋航空	2023 年 5 月 24 日	1,427,140.00	26,000	14	3.20	1,776.04	-	-
华泰证券	20230526000 01392	春秋航空	2023 年 5 月 26 日	56,350.00	1,000	14	3.20	70.14	-	-
华泰证券	20230529000 01457	春秋航空	2023 年 5 月 29 日	561,500.00	10,000	14	3.20	698.74	-	-
华泰证券	20230607000 25873	春秋航空	2023 年 6 月 7 日	1,369,680.00	26,000	14	3.20	1,704.50	-	-
华泰证券	20230609000 09687	春秋航空	2023 年 6 月 9 日	55,310.00	1,000	14	3.20	83.64	-	-
华泰证券	20230612000 39897	春秋航空	2023 年 6 月 12 日	568,000.00	10,000	14	3.20	706.86	-	-
华泰证券	20230613000 02627	春秋航空	2023 年 6 月 13 日	1,104,054.00	19,400	14	3.20	1,373.96	-	-
华泰证券	20230621000 14966	春秋航空	2023 年 6 月 21 日	1,547,780.00	26,000	14	3.20	1,238.22	1,494,220.00	1,238.22
华泰证券	20230626000 33528	春秋航空	2023 年 6 月 26 日	57,780.00	1,000	14	3.20	20.56	57,470.00	20.56
华泰证券	20230626000 40682	春秋航空	2023 年 6 月 26 日	577,800.00	10,000	14	3.20	205.44	574,700.00	205.44
华泰证券	20230627000 21893	春秋航空	2023 年 6 月 27 日	1,131,214.00	19,400	14	3.20	301.65	1,114,918.00	301.65
华泰证券	20230619000 01108	大华股份	2023 年 6 月 19 日	46,300.00	2,000	14	3.20	45.32	39,500.00	45.32
华泰证券	20230530000 16196	大秦铁路	2023 年 5 月 30 日	43,833.00	5,700	7	1.80	15.33	-	-
华泰证券	20230529000 01300	大秦铁路	2023 年 5 月 29 日	1,627,500.00	210,000	14	1.80	1,139.32	-	-

华泰证券	20230529000 01403	大秦铁路	2023 年 5 月 29 日	623, 875. 00	80, 500	14	1. 80	436. 66	-	-
华泰证券	20230606000 20671	大秦铁路	2023 年 6 月 6 日	42, 294. 00	5, 700	7	1. 80	14. 77	-	-
华泰证券	20230613000 18152	大秦铁路	2023 年 6 月 13 日	43, 149. 00	5, 700	7	1. 80	15. 12	-	-
华泰证券	20230612000 23149	大秦铁路	2023 年 6 月 12 日	1, 596, 000. 00	210, 000	14	1. 80	1, 117. 20	-	-
华泰证券	20230620000 10278	大秦铁路	2023 年 6 月 20 日	41, 781. 00	5, 700	7	1. 80	14. 63	-	-
华泰证券	20230619000 01070	大秦铁路	2023 年 6 月 19 日	1, 706, 892. 00	231, 600	14	3. 20	1, 668. 92	1, 720, 788. 00	1, 668. 92
华泰证券	20230627000 21867	大秦铁路	2023 年 6 月 27 日	42, 294. 00	5, 700	7	1. 80	6. 33	42, 351. 00	6. 33
华泰证券	20230626000 47362	大秦铁路	2023 年 6 月 26 日	1, 518, 300. 00	210, 000	14	1. 80	303. 68	1, 560, 300. 00	303. 68
华泰证券	20230630000 01506	大秦铁路	2023 年 6 月 30 日	6, 777, 646. 00	912, 200	14	3. 20	-	6, 777, 646. 00	-
华泰证券	20230109000 40888	大全能源	2023 年 1 月 9 日	2, 430, 000. 00	50, 000	14	3. 40	4, 819. 50	-	-
华泰证券	20230130000 74363	大全能源	2023 年 1 月 30 日	2, 461, 500. 00	50, 000	14	3. 40	3, 254. 72	-	-
华泰证券	20230118000 00205	大全能源	2023 年 1 月 18 日	1, 156, 386. 00	23, 100	28	3. 40	3, 057. 88	-	-
华泰证券	20230223000 00541	大全能源	2023 年 2 月 23 日	242, 550. 00	5, 000	14	3. 40	320. 74	-	-
华泰证券	20230309000 06484	大全能源	2023 年 3 月 9 日	241, 950. 00	5, 000	14	3. 40	319. 90	-	-
华泰证券	20230323000 06986	大全能源	2023 年 3 月 23 日	244, 250. 00	5, 000	14	3. 40	322. 98	-	-
华泰证券	20230406000 13752	大全能源	2023 年 4 月 6 日	241, 350. 00	5, 000	14	3. 40	319. 06	-	-
华泰证券	20230420000 05453	大全能源	2023 年 4 月 20 日	246, 200. 00	5, 000	14	3. 40	325. 50	-	-
华泰证券	20230504000 41187	大全能源	2023 年 5 月 4 日	202, 200. 00	5, 000	14	3. 40	267. 40	-	-
华泰证券	20230518000 40120	大全能源	2023 年 5 月 18 日	196, 950. 00	5, 000	14	3. 40	260. 40	-	-
华泰证券	20230601000 22856	大全能源	2023 年 6 月 1 日	211, 250. 00	5, 000	14	3. 40	279. 30	-	-
华泰证券	20230615000 32976	大全能源	2023 年 6 月 15 日	214, 650. 00	5, 000	14	3. 40	283. 78	-	-
华泰证券	20230629000	大全能源	2023 年 6 月	201, 500. 00	5, 000	14	3. 40	19. 03	202, 250. 00	19. 03

	43270		29 日							
华泰证券	20230630000 01483	德赛西威	2023 年 6 月 30 日	20,255,300.00	130,000	14	3.20		20,255,300.00	-
华泰证券	20230517000 01745	德业股份	2023 年 5 月 17 日	2,519,154.00	9,900	14	3.20	3,135.02	-	-
华泰证券	20230531000 07560	德业股份	2023 年 5 月 31 日	1,340,856.00	9,900	14	3.20	1,668.66	-	-
华泰证券	20230605000 01068	德业股份	2023 年 6 月 5 日	681,474.00	5,300	14	3.20	848.12	-	-
华泰证券	20230606000 02600	德业股份	2023 年 6 月 6 日	6,624,321.00	51,700	14	3.40	8,758.82	-	-
华泰证券	20230614000 49343	德业股份	2023 年 6 月 14 日	1,272,249.00	9,900	14	3.20	1,583.26	-	-
华泰证券	20230619000 24760	德业股份	2023 年 6 月 19 日	774,330.00	5,300	14	3.20	757.13	792,615.00	757.13
华泰证券	20230620000 34084	德业股份	2023 年 6 月 20 日	7,555,438.00	51,700	14	3.40	7,135.70	7,731,735.00	7,135.70
华泰证券	20230621000 01998	德业股份	2023 年 6 月 21 日	436,200.00	3,000	14	3.20	348.93	448,650.00	348.93
华泰证券	20230626000 03115	德业股份	2023 年 6 月 26 日	1,471,200.00	10,000	14	3.20	523.08	1,495,500.00	523.08
华泰证券	20230628000 44103	德业股份	2023 年 6 月 28 日	1,466,982.00	9,900	14	3.20	260.80	1,480,545.00	260.80
华泰证券	20230626000 03121	福莱特	2023 年 6 月 26 日	3,730,000.00	100,000	14	3.20	1,326.24	3,851,000.00	1,326.24
华泰证券	20230630000 01510	福莱特	2023 年 6 月 30 日	1,540,400.00	40,000	14	3.20		1,540,400.00	-
华泰证券	20230630000 01512	福耀玻璃	2023 年 6 月 30 日	75,285.00	2,100	14	3.20		75,285.00	-
华泰证券	20230524000 01891	复星医药	2023 年 5 月 24 日	76,128.00	2,400	14	3.20	94.78	-	-
华泰证券	20230526000 01388	复星医药	2023 年 5 月 26 日	47,355.00	1,500	14	3.20	58.94	-	-
华泰证券	20230523000 03184	高德红外	2023 年 5 月 23 日	125,164.00	11,600	14	3.20	155.82	-	-
华泰证券	20230525000 02830	高德红外	2023 年 5 月 25 日	34,419.00	3,300	14	3.20	42.84	-	-
华泰证券	20230606000 02625	高德红外	2023 年 6 月 6 日	12,288.00	1,200	14	3.20	15.26	-	-
华泰证券	20230606000 21181	高德红外	2023 年 6 月 6 日	118,784.00	11,600	14	3.20	147.84	-	-
华泰证券	20230608000 20522	高德红外	2023 年 6 月 8 日	32,670.00	3,300	14	3.20	52.20	-	-

华泰证券	2023062000032918	高德红外	2023 年 6 月 20 日	90,364.00	11,600	14	3.20	80.30	90,132.00	80.30
华泰证券	2023062000036373	高德红外	2023 年 6 月 20 日	9,348.00	1,200	14	3.20	8.30	9,324.00	8.30
华泰证券	2023062100001960	高德红外	2023 年 6 月 21 日	45,960.00	6,000	14	3.20	36.81	46,620.00	36.81
华泰证券	20230626000038163	高德红外	2023 年 6 月 26 日	24,816.00	3,300	14	3.20	8.84	25,641.00	8.84
华泰证券	2023063000001496	高德红外	2023 年 6 月 30 日	40,404.00	5,200	14	3.20	-	40,404.00	-
华泰证券	20230530000016190	工商银行	2023 年 5 月 30 日	200,994.00	41,700	7	1.80	70.35	-	-
华泰证券	2023052900001319	工商银行	2023 年 5 月 29 日	1,430,750.00	295,000	14	1.80	1,001.56	-	-
华泰证券	2023052900001340	工商银行	2023 年 5 月 29 日	475,300.00	98,000	14	1.80	332.78	-	-
华泰证券	20230606000020420	工商银行	2023 年 6 月 6 日	206,832.00	41,700	7	1.80	72.38	-	-
华泰证券	20230613000019372	工商银行	2023 年 6 月 13 日	208,500.00	41,700	7	1.80	73.01	-	-
华泰证券	20230612000022803	工商银行	2023 年 6 月 12 日	1,466,150.00	295,000	14	1.80	1,026.34	-	-
华泰证券	20230620000010272	工商银行	2023 年 6 月 20 日	201,411.00	41,700	7	1.80	70.49	-	-
华泰证券	20230627000021312	工商银行	2023 年 6 月 27 日	200,577.00	41,700	7	1.80	30.09	200,994.00	30.09
华泰证券	20230626000041242	工商银行	2023 年 6 月 26 日	1,407,150.00	295,000	14	1.80	281.44	1,421,900.00	281.44
华泰证券	2023052600001394	工业富联	2023 年 5 月 26 日	5,037,000.00	300,000	14	3.40	6,660.08	-	-
华泰证券	20230530000016234	工业富联	2023 年 5 月 30 日	1,803,000.00	100,000	14	3.40	2,383.92	-	-
华泰证券	2023060500001046	工业富联	2023 年 6 月 5 日	946,500.00	50,000	14	3.20	1,177.82	-	-
华泰证券	20230606000002660	工业富联	2023 年 6 月 6 日	911,000.00	50,000	14	3.20	1,133.72	-	-
华泰证券	20230609000010911	工业富联	2023 年 6 月 9 日	5,892,000.00	300,000	14	3.40	9,459.99	-	-
华泰证券	20230612000022906	工业富联	2023 年 6 月 12 日	42,700.00	2,000	14	3.20	53.20	-	-
华泰证券	20230613000002633	工业富联	2023 年 6 月 13 日	3,113,628.00	141,400	14	3.20	3,874.78	-	-
华泰证券	202306130000	工业富联	2023 年 6 月	2,202,000.00	100,000	14	3.40	2,911.58	-	-

	20716		13 日							
华泰证券	20230616000 02240	工业富联	2023 年 6 月 16 日	736,236.00	30,600	14	3.20	916.16	-	-
华泰证券	20230619000 19573	工业富联	2023 年 6 月 19 日	1,323,000.00	50,000	14	3.20	1,293.60	1,260,000.00	1,293.60
华泰证券	20230620000 30768	工业富联	2023 年 6 月 20 日	1,301,500.00	50,000	14	3.20	1,156.90	1,260,000.00	1,156.90
华泰证券	20230626000 31061	工业富联	2023 年 6 月 26 日	6,927,000.00	300,000	14	3.40	2,616.88	7,560,000.00	2,616.88
华泰证券	20230626000 31890	工业富联	2023 年 6 月 26 日	46,180.00	2,000	14	3.20	16.44	50,400.00	16.44
华泰证券	20230627000 18138	工业富联	2023 年 6 月 27 日	2,301,000.00	100,000	14	3.40	651.96	2,520,000.00	651.96
华泰证券	20230627000 20733	工业富联	2023 年 6 月 27 日	3,253,614.00	141,400	14	3.20	867.63	3,563,280.00	867.63
华泰证券	20230630000 15257	工业富联	2023 年 6 月 30 日	771,120.00	30,600	14	3.20	-	771,120.00	-
华泰证券	20230619000 01076	公牛集团	2023 年 6 月 19 日	947,140.00	9,200	14	3.20	926.09	883,752.00	926.09
华泰证券	20230530000 16194	光大银行	2023 年 5 月 30 日	81,900.00	26,000	7	1.80	28.70	-	-
华泰证券	20230529000 01321	光大银行	2023 年 5 月 29 日	1,987,051.00	622,900	14	1.80	1,390.90	-	-
华泰证券	20230529000 01329	光大银行	2023 年 5 月 29 日	669,900.00	210,000	14	1.80	469.00	-	-
华泰证券	20230606000 20339	光大银行	2023 年 6 月 6 日	82,680.00	26,000	7	1.80	28.91	-	-
华泰证券	20230613000 18247	光大银行	2023 年 6 月 13 日	81,900.00	26,000	7	1.80	28.70	-	-
华泰证券	20230612000 22737	光大银行	2023 年 6 月 12 日	1,974,593.00	622,900	14	1.80	1,382.22	-	-
华泰证券	20230620000 10265	光大银行	2023 年 6 月 20 日	79,300.00	26,000	7	1.80	27.79	-	-
华泰证券	20230627000 21959	光大银行	2023 年 6 月 27 日	79,300.00	26,000	7	1.80	11.91	79,820.00	11.91
华泰证券	20230626000 32075	光大银行	2023 年 6 月 26 日	1,874,929.00	622,900	14	1.80	375.00	1,912,303.00	375.00
华泰证券	20230524000 01888	国电南瑞	2023 年 5 月 24 日	5,396,000.00	200,000	14	3.20	6,714.96	-	-
华泰证券	20230511000 01762	海大集团	2023 年 5 月 11 日	56,375.00	1,100	14	3.20	70.14	-	-
华泰证券	20230529000 01451	海尔智家	2023 年 5 月 29 日	48,224.00	2,200	14	3.20	60.06	-	-

华泰证券	20230530000 16226	海尔智家	2023 年 5 月 30 日	47,740.00	2,200	14	3.20	59.36	-	-
华泰证券	20230602000 01113	海尔智家	2023 年 6 月 2 日	84,175.00	3,700	14	3.20	104.72	-	-
华泰证券	20230606000 02610	海尔智家	2023 年 6 月 6 日	79,625.00	3,500	14	3.20	99.12	-	-
华泰证券	20230612000 40560	海尔智家	2023 年 6 月 12 日	51,282.00	2,200	14	3.20	63.84	-	-
华泰证券	20230613000 21366	海尔智家	2023 年 6 月 13 日	51,150.00	2,200	14	3.20	63.70	-	-
华泰证券	20230626000 37586	海尔智家	2023 年 6 月 26 日	51,546.00	2,200	14	3.20	18.32	51,656.00	18.32
华泰证券	20230627000 18645	海尔智家	2023 年 6 月 27 日	52,360.00	2,200	14	3.20	13.95	51,656.00	13.95
华泰证券	20230601000 01698	海天味业	2023 年 6 月 1 日	7,949,032.00	158,600	14	3.20	9,892.12	-	-
华泰证券	20230615000 32606	海天味业	2023 年 6 月 15 日	8,101,288.00	158,600	14	3.20	10,081.54	-	-
华泰证券	20230616000 02235	海天味业	2023 年 6 月 16 日	1,041,420.00	20,400	14	3.20	1,295.98	-	-
华泰证券	20230629000 41005	海天味业	2023 年 6 月 29 日	7,470,060.00	158,600	14	3.20	664.01	7,430,410.00	664.01
华泰证券	20230630000 17503	海天味业	2023 年 6 月 30 日	955,740.00	20,400	14	3.20	-	955,740.00	-
华泰证券	20230612000 22819	合盛硅业	2023 年 6 月 12 日	450,255.00	6,500	14	3.20	560.28	-	-
华泰证券	20230626000 01451	合盛硅业	2023 年 6 月 26 日	336,287.00	4,900	14	3.20	119.56	343,098.00	119.56
华泰证券	20230626000 33690	合盛硅业	2023 年 6 月 26 日	446,095.00	6,500	14	3.20	158.60	455,130.00	158.60
华泰证券	20230517000 01733	恒力石化	2023 年 5 月 17 日	2,711,450.00	177,800	14	3.20	3,374.28	-	-
华泰证券	20230529000 01459	恒力石化	2023 年 5 月 29 日	4,792,600.00	310,000	14	3.20	5,964.14	-	-
华泰证券	20230531000 08491	恒力石化	2023 年 5 月 31 日	2,807,462.00	177,800	14	3.20	3,493.70	-	-
华泰证券	20230601000 01692	恒力石化	2023 年 6 月 1 日	2,162,830.00	138,200	14	3.20	2,691.50	-	-
华泰证券	20230602000 01099	恒力石化	2023 年 6 月 2 日	47,400.00	3,000	14	3.20	58.94	-	-
华泰证券	20230612000 40836	恒力石化	2023 年 6 月 12 日	4,423,700.00	310,000	14	3.20	5,505.08	-	-
华泰证券	20230614000	恒力石化	2023 年 6 月	2,608,326.00	177,800	14	3.20	3,245.90	-	-

	49575		14 日							
华泰证券	20230615000 26936	恒力石化	2023 年 6 月 15 日	2,045,360.00	138,200	14	3.20	2,545.34	-	-
华泰证券	20230616000 19173	恒力石化	2023 年 6 月 16 日	44,070.00	3,000	14	3.20	54.88	-	-
华泰证券	20230626000 42530	恒力石化	2023 年 6 月 26 日	4,417,500.00	310,000	14	3.20	1,570.68	4,442,300.00	1,570.68
华泰证券	20230630000 14703	恒力石化	2023 年 6 月 30 日	42,990.00	3,000	14	3.20	-	42,990.00	-
华泰证券	20230615000 03688	恒立液压	2023 年 6 月 15 日	4,200,655.00	66,100	14	3.20	5,227.46	-	-
华泰证券	20230629000 41488	恒立液压	2023 年 6 月 29 日	4,221,146.00	66,100	14	3.20	375.21	4,252,213.00	375.21
华泰证券	20230530000 16224	弘元绿能	2023 年 5 月 30 日	468,900.00	6,000	14	3.20	583.52	-	-
华泰证券	20230613000 02619	弘元绿能	2023 年 6 月 13 日	222,394.00	3,100	14	3.20	276.78	-	-
华泰证券	20230613000 21896	弘元绿能	2023 年 6 月 13 日	430,440.00	6,000	14	3.20	535.64	-	-
华泰证券	20230626000 01439	弘元绿能	2023 年 6 月 26 日	93,223.00	1,300	14	3.20	33.16	96,915.00	33.16
华泰证券	20230627000 19184	弘元绿能	2023 年 6 月 27 日	437,100.00	6,000	14	3.20	116.55	447,300.00	116.55
华泰证券	20230627000 20256	弘元绿能	2023 年 6 月 27 日	225,835.00	3,100	14	3.20	60.21	231,105.00	60.21
华泰证券	20230628000 04434	弘元绿能	2023 年 6 月 28 日	366,300.00	5,000	14	3.20	65.12	372,750.00	65.12
华泰证券	20230524000 01901	红塔证券	2023 年 5 月 24 日	448,148.00	56,300	14	3.20	557.76	-	-
华泰证券	20230526000 01404	红塔证券	2023 年 5 月 26 日	529,836.00	65,900	14	3.20	659.40	-	-
华泰证券	20230529000 01445	红塔证券	2023 年 5 月 29 日	15,800.00	2,000	14	3.20	19.60	-	-
华泰证券	20230530000 16228	红塔证券	2023 年 5 月 30 日	31,880.00	4,000	14	3.20	39.62	-	-
华泰证券	20230602000 01085	红塔证券	2023 年 6 月 2 日	310,440.00	39,000	14	3.20	386.40	-	-
华泰证券	20230605000 01102	红塔证券	2023 年 6 月 5 日	56,420.00	7,000	14	3.20	70.28	-	-
华泰证券	20230607000 20713	红塔证券	2023 年 6 月 7 日	439,703.00	56,300	14	3.20	547.26	-	-
华泰证券	20230609000 09474	红塔证券	2023 年 6 月 9 日	510,725.00	65,900	14	3.20	771.80	-	-

华泰证券	20230612000 42137	红塔证券	2023 年 6 月 12 日	15,460.00	2,000	14	3.20	19.18	-	-
华泰证券	20230613000 19288	红塔证券	2023 年 6 月 13 日	30,960.00	4,000	14	3.20	38.50	-	-
华泰证券	20230615000 03704	红塔证券	2023 年 6 月 15 日	1,243,200.00	160,000	14	3.20	1,547.14	-	-
华泰证券	20230616000 18085	红塔证券	2023 年 6 月 16 日	303,810.00	39,000	14	3.20	378.14	-	-
华泰证券	20230619000 18289	红塔证券	2023 年 6 月 19 日	54,670.00	7,000	14	3.20	53.46	52,150.00	53.46
华泰证券	20230621000 13101	红塔证券	2023 年 6 月 21 日	422,250.00	56,300	14	3.20	337.77	419,435.00	337.77
华泰证券	20230626000 31489	红塔证券	2023 年 6 月 26 日	485,024.00	65,900	14	3.20	172.44	490,955.00	172.44
华泰证券	20230626000 48490	红塔证券	2023 年 6 月 26 日	14,720.00	2,000	14	3.20	5.24	14,900.00	5.24
华泰证券	20230627000 17278	红塔证券	2023 年 6 月 27 日	29,800.00	4,000	14	3.20	7.95	29,800.00	7.95
华泰证券	20230629000 39435	红塔证券	2023 年 6 月 29 日	1,179,200.00	160,000	14	3.20	104.82	1,192,000.00	104.82
华泰证券	20230630000 18192	红塔证券	2023 年 6 月 30 日	290,550.00	39,000	14	3.20	-	290,550.00	-
华泰证券	20230223000 00539	沪硅产业	2023 年 2 月 23 日	100,150.00	5,000	14	3.40	132.44	-	-
华泰证券	20230309000 06490	沪硅产业	2023 年 3 月 9 日	102,950.00	5,000	14	3.40	136.08	-	-
华泰证券	20230323000 06984	沪硅产业	2023 年 3 月 23 日	117,050.00	5,000	14	3.40	154.84	-	-
华泰证券	20230406000 13750	沪硅产业	2023 年 4 月 6 日	123,450.00	5,000	14	3.40	163.24	-	-
华泰证券	20230420000 05377	沪硅产业	2023 年 4 月 20 日	124,800.00	5,000	14	3.40	165.06	-	-
华泰证券	20230504000 36679	沪硅产业	2023 年 5 月 4 日	119,650.00	5,000	14	3.40	158.20	-	-
华泰证券	20230515000 01565	沪硅产业	2023 年 5 月 15 日	678,720.00	33,600	14	3.40	897.40	-	-
华泰证券	20230518000 40062	沪硅产业	2023 年 5 月 18 日	102,650.00	5,000	14	3.40	135.80	-	-
华泰证券	20230529000 11158	沪硅产业	2023 年 5 月 29 日	717,696.00	33,600	14	3.40	948.92	-	-
华泰证券	20230601000 22367	沪硅产业	2023 年 6 月 1 日	110,050.00	5,000	14	3.40	145.46	-	-
华泰证券	20230615000	沪硅产业	2023 年 6 月	107,500.00	5,000	14	3.40	142.10	-	-

	29805		15 日							
华泰证券	2023062900044597	沪硅产业	2023 年 6 月 29 日	104,550.00	5,000	14	3.40	9.87	104,500.00	9.87
华泰证券	2023061500003672	华峰化学	2023 年 6 月 15 日	55,440.00	8,000	14	3.20	69.02	-	-
华泰证券	2023062100001958	华峰化学	2023 年 6 月 21 日	183,306.00	27,400	14	3.20	146.61	187,964.00	146.61
华泰证券	2023062900044506	华峰化学	2023 年 6 月 29 日	54,480.00	8,000	14	3.20	4.84	54,880.00	4.84
华泰证券	2023063000001494	华峰化学	2023 年 6 月 30 日	122,108.00	17,800	14	3.20	-	122,108.00	-
华泰证券	20230223000000579	华利集团	2023 年 2 月 23 日	288,950.00	5,000	14	3.40	382.06	-	-
华泰证券	20230309000006500	华利集团	2023 年 3 月 9 日	260,750.00	5,000	14	3.40	344.82	-	-
华泰证券	20230323000007014	华利集团	2023 年 3 月 23 日	267,750.00	5,000	14	3.40	354.06	-	-
华泰证券	20230406000012976	华利集团	2023 年 4 月 6 日	245,900.00	5,000	14	3.40	325.08	-	-
华泰证券	20230420000012547	华利集团	2023 年 4 月 20 日	242,050.00	5,000	14	3.40	320.04	-	-
华泰证券	20230504000024085	华利集团	2023 年 5 月 4 日	222,500.00	5,000	14	3.40	294.14	-	-
华泰证券	20230518000040400	华利集团	2023 年 5 月 18 日	218,550.00	5,000	14	3.40	288.96	-	-
华泰证券	20230523000003186	华利集团	2023 年 5 月 23 日	74,064.00	1,600	14	3.40	98.00	-	-
华泰证券	20230601000022267	华利集团	2023 年 6 月 1 日	197,700.00	5,000	14	3.40	261.38	-	-
华泰证券	20230606000014533	华利集团	2023 年 6 月 6 日	67,376.00	1,600	14	3.40	89.04	-	-
华泰证券	20230615000003670	华利集团	2023 年 6 月 15 日	127,894.00	2,600	14	3.40	169.12	-	-
华泰证券	20230615000039270	华利集团	2023 年 6 月 15 日	245,950.00	5,000	14	3.40	325.22	-	-
华泰证券	20230620000032387	华利集团	2023 年 6 月 20 日	74,208.00	1,600	14	3.40	70.10	77,984.00	70.10
华泰证券	20230629000043483	华利集团	2023 年 6 月 29 日	119,184.00	2,600	14	3.40	11.26	126,724.00	11.26
华泰证券	20230629000044758	华利集团	2023 年 6 月 29 日	229,200.00	5,000	14	3.40	21.65	243,700.00	21.65
华泰证券	20230614000016412	华能水电	2023 年 6 月 14 日	50,120.00	7,000	14	3.20	62.44	-	-

华泰证券	20230616000 02211	华能水电	2023 年 6 月 16 日	315,392.00	44,800	14	3.20	392.56	-	-
华泰证券	20230630000 17800	华能水电	2023 年 6 月 30 日	319,424.00	44,800	14	3.20	-	319,424.00	-
华泰证券	20230530000 16164	华侨城 A	2023 年 5 月 30 日	115,434.00	24,200	7	1.80	40.39	-	-
华泰证券	20230529000 01267	华侨城 A	2023 年 5 月 29 日	234,710.00	49,000	14	1.80	164.36	-	-
华泰证券	20230529000 01360	华侨城 A	2023 年 5 月 29 日	670,600.00	140,000	14	1.80	469.42	-	-
华泰证券	20230606000 17460	华侨城 A	2023 年 6 月 6 日	115,434.00	24,200	7	1.80	40.39	-	-
华泰证券	20230613000 19359	华侨城 A	2023 年 6 月 13 日	113,740.00	24,200	7	1.80	39.83	-	-
华泰证券	20230612000 22457	华侨城 A	2023 年 6 月 12 日	660,800.00	140,000	14	1.80	462.56	-	-
华泰证券	20230620000 10269	华侨城 A	2023 年 6 月 20 日	109,142.00	24,200	7	1.80	38.22	-	-
华泰证券	20230627000 21263	华侨城 A	2023 年 6 月 27 日	107,690.00	24,200	7	1.80	16.14	106,480.00	16.14
华泰证券	20230626000 35572	华侨城 A	2023 年 6 月 26 日	604,800.00	140,000	14	1.80	120.96	616,000.00	120.96
华泰证券	20230223000 00543	华润微	2023 年 2 月 23 日	273,250.00	5,000	14	3.40	361.34	-	-
华泰证券	20230309000 06480	华润微	2023 年 3 月 9 日	290,750.00	5,000	14	3.40	384.44	-	-
华泰证券	20230323000 06978	华润微	2023 年 3 月 23 日	312,400.00	5,000	14	3.40	413.00	-	-
华泰证券	20230406000 13772	华润微	2023 年 4 月 6 日	322,450.00	5,000	14	3.40	426.30	-	-
华泰证券	20230420000 05475	华润微	2023 年 4 月 20 日	304,150.00	5,000	14	3.40	402.22	-	-
华泰证券	20230504000 27307	华润微	2023 年 5 月 4 日	292,400.00	5,000	14	3.40	386.68	-	-
华泰证券	20230518000 39074	华润微	2023 年 5 月 18 日	294,500.00	5,000	14	3.40	389.34	-	-
华泰证券	20230601000 25215	华润微	2023 年 6 月 1 日	286,600.00	5,000	14	3.40	378.98	-	-
华泰证券	20230615000 29790	华润微	2023 年 6 月 15 日	271,250.00	5,000	14	3.40	358.68	-	-
华泰证券	20230629000 44591	华润微	2023 年 6 月 29 日	264,150.00	5,000	14	3.40	24.95	262,050.00	24.95
华泰证券	20230616000	华熙生物	2023 年 6 月	438,839.00	4,700	14	3.40	580.30	-	-

	02268		16 日							
华泰证券	20230620000 10323	华熙生物	2023 年 6 月 20 日	338,032.00	3,700	14	3.40	319.30	329,892.00	319.30
华泰证券	20230612000 23033	华熙生物	2023 年 6 月 12 日	388,500.00	4,200	28	3.40	660.42	374,472.00	660.42
华泰证券	20230630000 16863	华熙生物	2023 年 6 月 30 日	419,052.00	4,700	14	3.40	-	419,052.00	-
华泰证券	20230223000 00557	汇川技术	2023 年 2 月 23 日	366,450.00	5,000	14	3.40	484.54	-	-
华泰证券	20230309000 06504	汇川技术	2023 年 3 月 9 日	363,800.00	5,000	14	3.40	481.04	-	-
华泰证券	20230323000 07006	汇川技术	2023 年 3 月 23 日	340,000.00	5,000	14	3.40	449.54	-	-
华泰证券	20230406000 12974	汇川技术	2023 年 4 月 6 日	346,800.00	5,000	14	3.40	458.50	-	-
华泰证券	20230420000 12617	汇川技术	2023 年 4 月 20 日	313,000.00	5,000	14	3.40	413.84	-	-
华泰证券	20230504000 20169	汇川技术	2023 年 5 月 4 日	299,750.00	5,000	14	3.40	396.34	-	-
华泰证券	20230518000 40166	汇川技术	2023 年 5 月 18 日	295,850.00	5,000	14	3.40	391.16	-	-
华泰证券	20230601000 24526	汇川技术	2023 年 6 月 1 日	296,950.00	5,000	14	3.40	392.70	-	-
华泰证券	20230615000 37117	汇川技术	2023 年 6 月 15 日	314,650.00	5,000	14	3.40	416.08	-	-
华泰证券	20230629000 42684	汇川技术	2023 年 6 月 29 日	320,000.00	5,000	14	3.40	30.22	321,050.00	30.22
华泰证券	20230530000 16178	建设银行	2023 年 5 月 30 日	188,632.00	29,200	7	1.80	66.01	-	-
华泰证券	20230529000 01333	建设银行	2023 年 5 月 29 日	1,401,840.00	216,000	14	1.80	981.26	-	-
华泰证券	20230529000 01391	建设银行	2023 年 5 月 29 日	477,015.00	73,500	14	1.80	333.90	-	-
华泰证券	20230606000 15008	建设银行	2023 年 6 月 6 日	189,216.00	29,200	7	1.80	66.22	-	-
华泰证券	20230613000 19753	建设银行	2023 年 6 月 13 日	190,092.00	29,200	7	1.80	66.50	-	-
华泰证券	20230612000 22774	建设银行	2023 年 6 月 12 日	1,399,680.00	216,000	14	1.80	979.72	-	-
华泰证券	20230620000 10294	建设银行	2023 年 6 月 20 日	179,872.00	29,200	7	1.80	62.93	-	-
华泰证券	20230627000 20958	建设银行	2023 年 6 月 27 日	182,208.00	29,200	7	1.80	27.33	182,792.00	27.33

华泰证券	2023062600039415	建设银行	2023 年 6 月 26 日	1,326,240.00	216,000	14	1.80	265.24	1,352,160.00	265.24
华泰证券	2023011100028075	健帆生物	2023 年 1 月 11 日	440,190.00	13,400	14	3.40	789.83	-	-
华泰证券	2023011200015819	健帆生物	2023 年 1 月 12 日	647,006.00	20,200	14	3.40	1,099.98	-	-
华泰证券	2023013000070581	健帆生物	2023 年 1 月 30 日	693,870.00	20,200	14	3.40	917.42	-	-
华泰证券	2023013000080199	健帆生物	2023 年 1 月 30 日	460,290.00	13,400	14	3.40	608.58	-	-
华泰证券	2023021300078080	健帆生物	2023 年 2 月 13 日	694,274.00	20,200	14	3.40	917.98	-	-
华泰证券	2023021300079430	健帆生物	2023 年 2 月 13 日	460,558.00	13,400	14	3.40	609.00	-	-
华泰证券	2023022300000589	健帆生物	2023 年 2 月 23 日	163,800.00	5,000	14	3.40	216.58	-	-
华泰证券	2023022300000595	健帆生物	2023 年 2 月 23 日	2,653,560.00	81,000	14	3.40	3,508.54	-	-
华泰证券	2023022700064208	健帆生物	2023 年 2 月 27 日	430,274.00	13,400	14	3.40	568.96	-	-
华泰证券	2023022700074508	健帆生物	2023 年 2 月 27 日	648,622.00	20,200	14	3.40	857.64	-	-
华泰证券	2023030900006536	健帆生物	2023 年 3 月 9 日	2,516,670.00	81,000	14	3.40	3,327.66	-	-
华泰证券	2023030900006538	健帆生物	2023 年 3 月 9 日	155,350.00	5,000	14	3.40	205.38	-	-
华泰证券	2023031300063084	健帆生物	2023 年 3 月 13 日	621,756.00	20,200	14	3.40	822.08	-	-
华泰证券	2023031300070318	健帆生物	2023 年 3 月 13 日	412,452.00	13,400	14	3.40	545.30	-	-
华泰证券	2023032300007020	健帆生物	2023 年 3 月 23 日	2,474,550.00	81,000	14	3.40	3,271.94	-	-
华泰证券	2023032300007026	健帆生物	2023 年 3 月 23 日	152,750.00	5,000	14	3.40	202.02	-	-
华泰证券	2023032700069985	健帆生物	2023 年 3 月 27 日	627,816.00	20,200	14	3.40	830.06	-	-
华泰证券	2023040600013020	健帆生物	2023 年 4 月 6 日	157,250.00	5,000	14	3.40	207.90	-	-
华泰证券	2023040600013022	健帆生物	2023 年 4 月 6 日	2,547,450.00	81,000	14	3.40	3,368.26	-	-
华泰证券	2023041000065471	健帆生物	2023 年 4 月 10 日	644,784.00	20,200	14	3.40	852.60	-	-
华泰证券	20230420000	健帆生物	2023 年 4 月	153,450.00	5,000	14	3.40	202.86	-	-

	09147		20 日							
华泰证券	20230420000 09149	健帆生物	2023 年 4 月 20 日	2,485,890.00	81,000	14	3.40	3,286.92	-	-
华泰证券	20230504000 37853	健帆生物	2023 年 5 月 4 日	146,000.00	5,000	14	3.40	193.06	-	-
华泰证券	20230504000 37855	健帆生物	2023 年 5 月 4 日	2,365,200.00	81,000	14	3.40	3,127.32	-	-
华泰证券	20230518000 40572	健帆生物	2023 年 5 月 18 日	144,800.00	5,000	14	3.40	191.52	-	-
华泰证券	20230518000 40574	健帆生物	2023 年 5 月 18 日	2,345,760.00	81,000	14	3.40	3,101.56	-	-
华泰证券	20230530000 16174	交通银行	2023 年 5 月 30 日	180,516.00	30,700	7	1.80	63.21	-	-
华泰证券	20230529000 01315	交通银行	2023 年 5 月 29 日	1,871,440.00	314,000	14	1.80	1,309.98	-	-
华泰证券	20230529000 01380	交通银行	2023 年 5 月 29 日	646,660.00	108,500	14	1.80	452.62	-	-
华泰证券	20230606000 16713	交通银行	2023 年 6 月 6 日	181,437.00	30,700	7	1.80	63.49	-	-
华泰证券	20230613000 20256	交通银行	2023 年 6 月 13 日	182,051.00	30,700	7	1.80	63.70	-	-
华泰证券	20230612000 23035	交通银行	2023 年 6 月 12 日	1,849,460.00	314,000	14	1.80	1,294.58	-	-
华泰证券	20230620000 10273	交通银行	2023 年 6 月 20 日	175,297.00	30,700	7	1.80	61.32	-	-
华泰证券	20230627000 20785	交通银行	2023 年 6 月 27 日	176,832.00	30,700	7	1.80	26.52	178,060.00	26.52
华泰证券	20230626000 34688	交通银行	2023 年 6 月 26 日	1,774,100.00	314,000	14	1.80	354.84	1,821,200.00	354.84
华泰证券	20230505000 01595	金地集团	2023 年 5 月 5 日	1,817,760.00	216,400	14	3.20	2,262.12	-	-
华泰证券	20230519000 10237	金地集团	2023 年 5 月 19 日	1,653,296.00	216,400	14	3.20	2,057.44	-	-
华泰证券	20230602000 13160	金地集团	2023 年 6 月 2 日	1,644,640.00	216,400	14	3.20	2,046.66	-	-
华泰证券	20230616000 19666	金地集团	2023 年 6 月 16 日	1,666,280.00	216,400	14	3.20	2,073.54	-	-
华泰证券	20230630000 16044	金地集团	2023 年 6 月 30 日	1,560,244.00	216,400	14	3.20	-	1,560,244.00	-
华泰证券	20230223000 00577	金龙鱼	2023 年 2 月 23 日	234,500.00	5,000	14	3.40	310.10	-	-
华泰证券	20230309000 06498	金龙鱼	2023 年 3 月 9 日	222,850.00	5,000	14	3.40	294.70	-	-

华泰证券	20230323000 06994	金龙鱼	2023 年 3 月 23 日	217,200.00	5,000	14	3.40	287.14	-	-
华泰证券	20230406000 12972	金龙鱼	2023 年 4 月 6 日	214,300.00	5,000	14	3.40	283.36	-	-
华泰证券	20230420000 12549	金龙鱼	2023 年 4 月 20 日	210,900.00	5,000	14	3.40	278.88	-	-
华泰证券	20230504000 31751	金龙鱼	2023 年 5 月 4 日	217,300.00	5,000	14	3.40	287.28	-	-
华泰证券	20230518000 40132	金龙鱼	2023 年 5 月 18 日	205,800.00	5,000	14	3.40	272.16	-	-
华泰证券	20230601000 37548	金龙鱼	2023 年 6 月 1 日	202,300.00	5,000	14	3.40	267.54	-	-
华泰证券	20230615000 26995	金龙鱼	2023 年 6 月 15 日	206,000.00	5,000	14	3.40	272.44	-	-
华泰证券	20230629000 39980	金龙鱼	2023 年 6 月 29 日	199,050.00	5,000	14	3.40	18.80	199,950.00	18.80
华泰证券	20230515000 01575	金山办公	2023 年 5 月 15 日	830,000.00	2,000	14	3.40	1,097.46	-	-
华泰证券	20230529000 11144	金山办公	2023 年 5 月 29 日	831,920.00	2,000	14	3.40	1,099.98	-	-
华泰证券	20230530000 16220	金山办公	2023 年 5 月 30 日	4,391,900.00	10,000	14	3.40	5,807.06	-	-
华泰证券	20230612000 42048	金山办公	2023 年 6 月 12 日	976,000.00	2,000	14	3.40	1,290.52	-	-
华泰证券	20230613000 20826	金山办公	2023 年 6 月 13 日	4,803,700.00	10,000	14	3.40	6,351.52	-	-
华泰证券	20230626000 33170	金山办公	2023 年 6 月 26 日	955,420.00	2,000	14	3.40	360.92	944,440.00	360.92
华泰证券	20230627000 15883	金山办公	2023 年 6 月 27 日	5,045,500.00	10,000	14	3.40	1,429.56	4,722,200.00	1,429.56
华泰证券	20230103000 28111	锦浪科技	2023 年 1 月 3 日	545,130.00	3,000	14	3.40	720.72	-	-
华泰证券	20230105000 17563	锦浪科技	2023 年 1 月 5 日	882,600.00	5,000	14	3.40	1,167.04	-	-
华泰证券	20230106000 00742	锦浪科技	2023 年 1 月 6 日	859,160.00	4,700	14	3.40	1,135.96	-	-
华泰证券	20230112000 15821	锦浪科技	2023 年 1 月 12 日	1,259,250.00	7,300	14	3.40	2,140.74	-	-
华泰证券	20230113000 00289	锦浪科技	2023 年 1 月 13 日	2,512,230.00	14,700	14	3.40	4,033.59	-	-
华泰证券	20230117000 32451	锦浪科技	2023 年 1 月 17 日	524,610.00	3,000	14	3.40	693.70	-	-
华泰证券	20230104000	锦浪科技	2023 年 1 月 4	8,970,000.00	52,000	28	3.40	23,720.76	-	-

	00758		日							
华泰证券	20230119000 13722	锦浪科技	2023 年 1 月 19 日	858,500.00	5,000	14	3.40	1,135.12	-	-
华泰证券	20230120000 07257	锦浪科技	2023 年 1 月 20 日	820,432.00	4,700	14	3.40	1,084.86	-	-
华泰证券	20230130000 85075	锦浪科技	2023 年 1 月 30 日	1,323,052.00	7,300	14	3.40	1,749.44	-	-
华泰证券	20230130000 85095	锦浪科技	2023 年 1 月 30 日	2,664,228.00	14,700	14	3.40	3,522.68	-	-
华泰证券	20230131000 33075	锦浪科技	2023 年 1 月 31 日	549,330.00	3,000	14	3.40	726.32	-	-
华泰证券	20230202000 14495	锦浪科技	2023 年 2 月 2 日	848,950.00	5,000	14	3.40	1,122.52	-	-
华泰证券	20230203000 11212	锦浪科技	2023 年 2 月 3 日	781,610.00	4,700	14	3.40	1,033.48	-	-
华泰证券	20230213000 63538	锦浪科技	2023 年 2 月 13 日	2,461,956.00	14,700	14	3.40	3,255.28	-	-
华泰证券	20230213000 63614	锦浪科技	2023 年 2 月 13 日	1,222,604.00	7,300	14	3.40	1,616.58	-	-
华泰证券	20230214000 24643	锦浪科技	2023 年 2 月 14 日	506,100.00	3,000	14	3.40	669.20	-	-
华泰证券	20230201000 17374	锦浪科技	2023 年 2 月 1 日	8,910,200.00	52,000	28	3.40	23,562.56	-	-
华泰证券	20230216000 13697	锦浪科技	2023 年 2 月 16 日	810,650.00	5,000	14	3.40	1,071.84	-	-
华泰证券	20230217000 20220	锦浪科技	2023 年 2 月 17 日	748,005.00	4,700	14	3.40	989.10	-	-
华泰证券	20230227000 66112	锦浪科技	2023 年 2 月 27 日	2,334,360.00	14,700	14	3.40	3,086.58	-	-
华泰证券	20230227000 66614	锦浪科技	2023 年 2 月 27 日	1,159,240.00	7,300	14	3.40	1,532.72	-	-
华泰证券	20230228000 21546	锦浪科技	2023 年 2 月 28 日	476,340.00	3,000	14	3.40	629.86	-	-
华泰证券	20230302000 11831	锦浪科技	2023 年 3 月 2 日	761,750.00	5,000	14	3.40	1,007.16	-	-
华泰证券	20230303000 12169	锦浪科技	2023 年 3 月 3 日	715,810.00	4,700	14	3.40	946.40	-	-
华泰证券	20230308000 00549	锦浪科技	2023 年 3 月 8 日	4,596,600.00	30,000	14	3.40	6,077.68	-	-
华泰证券	20230313000 68914	锦浪科技	2023 年 3 月 13 日	2,233,665.00	14,700	14	3.40	2,953.44	-	-
华泰证券	20230313000 68978	锦浪科技	2023 年 3 月 13 日	1,109,235.00	7,300	14	3.40	1,466.64	-	-

华泰证券	20230314000 19498	锦浪科技	2023 年 3 月 14 日	440,040.00	3,000	14	3.40	581.84	-	-
华泰证券	20230301000 15867	锦浪科技	2023 年 3 月 1 日	8,060,000.00	52,000	28	3.40	21,314.16	-	-
华泰证券	20230316000 13344	锦浪科技	2023 年 3 月 16 日	706,700.00	5,000	14	3.40	934.36	-	-
华泰证券	20230317000 09739	锦浪科技	2023 年 3 月 17 日	653,300.00	4,700	14	3.40	863.80	-	-
华泰证券	20230322000 08345	锦浪科技	2023 年 3 月 22 日	4,115,700.00	30,000	14	3.40	5,830.65	-	-
华泰证券	20230327000 68881	锦浪科技	2023 年 3 月 27 日	2,015,076.00	14,700	14	3.40	2,664.34	-	-
华泰证券	20230327000 69921	锦浪科技	2023 年 3 月 27 日	1,000,684.00	7,300	14	3.40	1,323.14	-	-
华泰证券	20230328000 23957	锦浪科技	2023 年 3 月 28 日	399,900.00	3,000	14	3.40	528.78	-	-
华泰证券	20230330000 17453	锦浪科技	2023 年 3 月 30 日	670,750.00	5,000	14	3.40	886.90	-	-
华泰证券	20230331000 08779	锦浪科技	2023 年 3 月 31 日	627,826.00	4,700	14	3.40	830.20	-	-
华泰证券	20230406000 00769	锦浪科技	2023 年 4 月 6 日	6,509,000.00	50,000	14	3.40	8,606.36	-	-
华泰证券	20230406000 12964	锦浪科技	2023 年 4 月 6 日	3,905,400.00	30,000	14	3.40	5,163.76	-	-
华泰证券	20230410000 60465	锦浪科技	2023 年 4 月 10 日	945,642.00	7,300	14	3.40	1,250.34	-	-
华泰证券	20230410000 64939	锦浪科技	2023 年 4 月 10 日	1,904,238.00	14,700	14	3.40	2,517.90	-	-
华泰证券	20230411000 17742	锦浪科技	2023 年 4 月 11 日	387,000.00	3,000	14	3.40	511.70	-	-
华泰证券	20230329000 18748	锦浪科技	2023 年 3 月 29 日	6,931,600.00	52,000	28	3.40	18,330.20	-	-
华泰证券	20230413000 12163	锦浪科技	2023 年 4 月 13 日	625,500.00	5,000	14	3.40	827.12	-	-
华泰证券	20230414000 08163	锦浪科技	2023 年 4 月 14 日	585,996.00	4,700	14	3.40	774.76	-	-
华泰证券	20230420000 09049	锦浪科技	2023 年 4 月 20 日	6,102,500.00	50,000	14	3.40	8,068.90	-	-
华泰证券	20230420000 12495	锦浪科技	2023 年 4 月 20 日	3,661,500.00	30,000	14	3.40	4,841.34	-	-
华泰证券	20230424000 35757	锦浪科技	2023 年 4 月 24 日	1,727,985.00	14,700	14	3.40	2,284.80	-	-
华泰证券	20230424000	锦浪科技	2023 年 4 月	858,115.00	7,300	14	3.40	1,134.56	-	-

	39107		24 日							
华泰证券	20230425000 57567	锦浪科技	2023 年 4 月 25 日	334,020.00	3,000	14	3.40	441.70	-	-
华泰证券	20230427000 19668	锦浪科技	2023 年 4 月 27 日	598,100.00	5,000	14	3.40	790.86	-	-
华泰证券	20230428000 12818	锦浪科技	2023 年 4 月 28 日	534,860.00	4,700	14	3.40	707.14	-	-
华泰证券	20230504000 42647	锦浪科技	2023 年 5 月 4 日	5,730,500.00	50,000	14	3.40	7,576.94	-	-
华泰证券	20230504000 42729	锦浪科技	2023 年 5 月 4 日	3,438,300.00	30,000	14	3.40	4,546.22	-	-
华泰证券	20230508000 18545	锦浪科技	2023 年 5 月 8 日	1,634,346.00	14,700	14	3.40	2,161.04	-	-
华泰证券	20230509000 14901	锦浪科技	2023 年 5 月 9 日	327,330.00	3,000	14	3.40	432.74	-	-
华泰证券	20230426000 28432	锦浪科技	2023 年 4 月 26 日	6,421,480.00	52,000	28	3.40	16,981.16	-	-
华泰证券	20230511000 10253	锦浪科技	2023 年 5 月 11 日	547,600.00	5,000	14	3.40	724.08	-	-
华泰证券	20230512000 12974	锦浪科技	2023 年 5 月 12 日	503,135.00	4,700	14	3.40	665.28	-	-
华泰证券	20230518000 39198	锦浪科技	2023 年 5 月 18 日	3,245,400.00	30,000	14	3.40	4,291.14	-	-
华泰证券	20230518000 40554	锦浪科技	2023 年 5 月 18 日	5,409,000.00	50,000	14	3.40	7,151.90	-	-
华泰证券	20230522000 49898	锦浪科技	2023 年 5 月 22 日	1,566,579.00	14,700	14	3.40	2,071.44	-	-
华泰证券	20230523000 08208	锦浪科技	2023 年 5 月 23 日	316,560.00	3,000	14	3.40	418.60	-	-
华泰证券	20230526000 13886	锦浪科技	2023 年 5 月 26 日	494,017.00	4,700	14	3.40	653.24	-	-
华泰证券	20230601000 24545	锦浪科技	2023 年 6 月 1 日	4,983,000.00	50,000	14	3.40	6,588.68	-	-
华泰证券	20230601000 30405	锦浪科技	2023 年 6 月 1 日	2,989,800.00	30,000	14	3.40	3,953.18	-	-
华泰证券	20230605000 29411	锦浪科技	2023 年 6 月 5 日	1,448,097.00	14,700	14	3.40	1,914.78	-	-
华泰证券	20230607000 02493	锦浪科技	2023 年 6 月 7 日	1,685,024.00	17,600	14	3.40	2,227.96	-	-
华泰证券	20230609000 08165	锦浪科技	2023 年 6 月 9 日	447,675.00	4,700	14	3.40	718.76	-	-
华泰证券	20230615000 03674	锦浪科技	2023 年 6 月 15 日	700,350.00	6,900	14	3.40	925.96	-	-

华泰证券	20230615000 34697	锦浪科技	2023 年 6 月 15 日	3,045,000.00	30,000	14	3.40	4,026.12	-	-
华泰证券	20230615000 35336	锦浪科技	2023 年 6 月 15 日	5,075,000.00	50,000	14	3.40	6,710.34	-	-
华泰证券	20230619000 22782	锦浪科技	2023 年 6 月 19 日	1,536,444.00	14,700	14	3.40	1,596.21	1,530,270.00	1,596.21
华泰证券	20230621000 01966	锦浪科技	2023 年 6 月 21 日	305,700.00	3,000	14	3.40	259.83	312,300.00	259.83
华泰证券	20230621000 15294	锦浪科技	2023 年 6 月 21 日	1,793,440.00	17,600	14	3.40	1,524.42	1,832,160.00	1,524.42
华泰证券	20230626000 42112	锦浪科技	2023 年 6 月 26 日	490,069.00	4,700	14	3.40	185.12	489,270.00	185.12
华泰证券	20230629000 39517	锦浪科技	2023 年 6 月 29 日	2,996,700.00	30,000	14	3.40	283.02	3,123,000.00	283.02
华泰证券	20230629000 41050	锦浪科技	2023 年 6 月 29 日	4,994,500.00	50,000	14	3.40	471.70	5,205,000.00	471.70
华泰证券	20230629000 41397	锦浪科技	2023 年 6 月 29 日	689,241.00	6,900	14	3.40	65.10	718,290.00	65.10
华泰证券	20230223000 00567	晶盛机电	2023 年 2 月 23 日	344,100.00	5,000	14	3.40	455.00	-	-
华泰证券	20230309000 06512	晶盛机电	2023 年 3 月 9 日	342,900.00	5,000	14	3.40	453.46	-	-
华泰证券	20230323000 06996	晶盛机电	2023 年 3 月 23 日	311,750.00	5,000	14	3.40	412.16	-	-
华泰证券	20230406000 13012	晶盛机电	2023 年 4 月 6 日	346,500.00	5,000	14	3.40	458.22	-	-
华泰证券	20230413000 00912	晶盛机电	2023 年 4 月 13 日	13,182,750.00	189,000	14	3.20	8,202.60	-	-
华泰证券	20230420000 04282	晶盛机电	2023 年 4 月 13 日	13,182,750.00	189,000	8	3.20	1,171.80	-	-
华泰证券	20230420000 12489	晶盛机电	2023 年 4 月 20 日	342,000.00	5,000	14	3.40	452.20	-	-
华泰证券	20230504000 26765	晶盛机电	2023 年 5 月 4 日	337,050.00	5,000	14	3.40	445.62	-	-
华泰证券	20230518000 01272	晶盛机电	2023 年 5 月 18 日	10,819,500.00	150,000	14	3.40	14,305.76	-	-
华泰证券	20230518000 40060	晶盛机电	2023 年 5 月 18 日	360,650.00	5,000	14	3.40	476.84	-	-
华泰证券	20230519000 02269	晶盛机电	2023 年 5 月 19 日	3,625,000.00	50,000	14	3.40	4,793.04	-	-
华泰证券	20230601000 24816	晶盛机电	2023 年 6 月 1 日	10,177,500.00	150,000	14	3.40	13,456.94	-	-
华泰证券	20230601000	晶盛机电	2023 年 6 月 1	339,250.00	5,000	14	3.40	448.56	-	-

	29108		日							
华泰证券	20230616000 02169	晶盛机电	2023 年 6 月 16 日	9,065,428.00	132,400	14	3.40	3,424.72	-	-
华泰证券	20230620000 23899	晶盛机电	2023 年 6 月 16 日	9,065,428.00	132,400	5	3.40	856.18	-	-
华泰证券	20230615000 29511	晶盛机电	2023 年 6 月 15 日	339,250.00	5,000	14	3.40	448.56	-	-
华泰证券	20230626000 01423	晶盛机电	2023 年 6 月 26 日	12,832,404.00	191,300	14	3.40	4,847.80	13,563,170 .00	4,847.80
华泰证券	20230629000 40625	晶盛机电	2023 年 6 月 29 日	350,600.00	5,000	14	3.40	33.11	354,500.00	33.11
华泰证券	20230626000 01447	君正集团	2023 年 6 月 26 日	5,726.00	1,400	14	3.20	2.04	5,740.00	2.04
华泰证券	20230110000 17249	凯赛生物	2023 年 1 月 10 日	3,046,113.00	49,700	14	3.40	5,753.80	-	-
华泰证券	20230130000 69179	凯赛生物	2023 年 1 月 30 日	3,280,200.00	49,700	14	3.40	4,337.20	-	-
华泰证券	20230213000 63584	凯赛生物	2023 年 2 月 13 日	3,409,420.00	49,700	14	3.40	4,508.00	-	-
华泰证券	20230223000 00551	凯赛生物	2023 年 2 月 23 日	337,800.00	5,000	14	3.40	446.60	-	-
华泰证券	20230227000 77202	凯赛生物	2023 年 2 月 27 日	3,246,901.00	49,700	14	3.40	4,293.10	-	-
华泰证券	20230309000 06494	凯赛生物	2023 年 3 月 9 日	312,250.00	5,000	14	3.40	412.86	-	-
华泰证券	20230313000 68960	凯赛生物	2023 年 3 月 13 日	3,026,730.00	49,700	14	3.40	4,002.04	-	-
华泰证券	20230323000 06990	凯赛生物	2023 年 3 月 23 日	316,200.00	5,000	14	3.40	418.04	-	-
华泰证券	20230327000 68717	凯赛生物	2023 年 3 月 27 日	3,200,680.00	49,700	14	3.40	4,232.06	-	-
华泰证券	20230406000 13756	凯赛生物	2023 年 4 月 6 日	303,000.00	5,000	14	3.40	400.68	-	-
华泰证券	20230410000 58603	凯赛生物	2023 年 4 月 10 日	3,016,790.00	49,700	14	3.40	3,988.88	-	-
华泰证券	20230420000 12497	凯赛生物	2023 年 4 月 20 日	286,550.00	5,000	14	3.40	378.84	-	-
华泰证券	20230424000 30631	凯赛生物	2023 年 4 月 24 日	2,865,205.00	49,700	14	3.40	3,788.40	-	-
华泰证券	20230504000 36579	凯赛生物	2023 年 5 月 4 日	269,250.00	5,000	14	3.40	356.02	-	-
华泰证券	20230508000 44293	凯赛生物	2023 年 5 月 8 日	2,722,566.00	49,700	14	3.40	3,599.82	-	-

华泰证券	20230518000 38188	凯赛生物	2023 年 5 月 18 日	261,850.00	5,000	14	3.40	346.22	-	-
华泰证券	20230522000 43862	凯赛生物	2023 年 5 月 22 日	2,654,974.00	49,700	14	3.40	3,510.50	-	-
华泰证券	20230601000 24657	凯赛生物	2023 年 6 月 1 日	261,450.00	5,000	14	3.40	617.25	-	-
华泰证券	20230626000 40866	凯赛生物	2023 年 6 月 26 日	319,500.00	5,000	14	3.40	120.72	311,300.00	120.72
华泰证券	20230223000 00578	康龙化成	2023 年 2 月 23 日	316,050.00	5,000	14	3.40	417.90	-	-
华泰证券	20230309000 06526	康龙化成	2023 年 3 月 9 日	287,150.00	5,000	14	3.40	379.68	-	-
华泰证券	20230323000 07012	康龙化成	2023 年 3 月 23 日	291,600.00	5,000	14	3.40	385.56	-	-
华泰证券	20230406000 13024	康龙化成	2023 年 4 月 6 日	250,650.00	5,000	14	3.40	331.38	-	-
华泰证券	20230420000 12621	康龙化成	2023 年 4 月 20 日	263,350.00	5,000	14	3.40	348.18	-	-
华泰证券	20230504000 32695	康龙化成	2023 年 5 月 4 日	236,000.00	5,000	14	3.40	312.06	-	-
华泰证券	20230518000 40610	康龙化成	2023 年 5 月 18 日	239,250.00	5,000	14	3.40	316.40	-	-
华泰证券	20230601000 28418	康龙化成	2023 年 6 月 1 日	241,600.00	5,000	14	3.40	319.48	-	-
华泰证券	20230615000 38552	康龙化成	2023 年 6 月 15 日	236,850.00	5,000	14	3.40	313.18	-	-
华泰证券	20230616000 02171	康龙化成	2023 年 6 月 16 日	441,232.00	9,200	14	3.40	583.38	-	-
华泰证券	20230629000 39725	康龙化成	2023 年 6 月 29 日	189,200.00	5,000	14	3.40	17.87	191,400.00	17.87
华泰证券	20230630000 20810	康龙化成	2023 年 6 月 30 日	352,176.00	9,200	14	3.40	-	352,176.00	-
华泰证券	20230109000 37538	康泰生物	2023 年 1 月 9 日	1,218,805.00	35,900	14	3.40	2,417.31	-	-
华泰证券	20230130000 72089	康泰生物	2023 年 1 月 30 日	1,342,660.00	35,900	14	3.40	1,775.34	-	-
华泰证券	20230117000 32821	康泰生物	2023 年 1 月 17 日	145,002.00	3,900	28	3.40	383.32	-	-
华泰证券	20230207000 00331	康泰生物	2023 年 2 月 7 日	74,460.00	2,000	14	3.40	98.42	-	-
华泰证券	20230213000 78190	康泰生物	2023 年 2 月 13 日	1,343,378.00	35,900	14	3.40	1,776.18	-	-
华泰证券	20230223000	康泰生物	2023 年 2 月	176,700.00	5,000	14	3.40	233.66	-	-

	00591		23 日							
华泰证券	20230309000 06522	康泰生物	2023 年 3 月 9 日	170,450.00	5,000	14	3.40	225.40	-	-
华泰证券	20230313000 00713	康泰生物	2023 年 3 月 13 日	133,320.00	4,000	14	3.40	176.26	-	-
华泰证券	20230314000 00554	康泰生物	2023 年 3 月 14 日	33,460.00	1,000	14	3.40	44.24	-	-
华泰证券	20230323000 05898	康泰生物	2023 年 3 月 23 日	161,800.00	5,000	14	3.40	213.92	-	-
华泰证券	20230327000 68017	康泰生物	2023 年 3 月 27 日	131,720.00	4,000	14	3.40	174.16	-	-
华泰证券	20230406000 12936	康泰生物	2023 年 4 月 6 日	159,400.00	5,000	14	3.40	210.70	-	-
华泰证券	20230410000 61771	康泰生物	2023 年 4 月 10 日	134,360.00	4,000	14	3.40	177.66	-	-
华泰证券	20230420000 09153	康泰生物	2023 年 4 月 20 日	158,250.00	5,000	14	3.40	209.30	-	-
华泰证券	20230424000 38197	康泰生物	2023 年 4 月 24 日	123,440.00	4,000	14	3.40	163.24	-	-
华泰证券	20230504000 37321	康泰生物	2023 年 5 月 4 日	150,900.00	5,000	14	3.40	199.50	-	-
华泰证券	20230508000 49411	康泰生物	2023 年 5 月 8 日	121,280.00	4,000	14	3.40	160.30	-	-
华泰证券	20230518000 40230	康泰生物	2023 年 5 月 18 日	144,150.00	5,000	14	3.40	190.54	-	-
华泰证券	20230522000 58838	康泰生物	2023 年 5 月 22 日	116,920.00	4,000	14	3.40	154.56	-	-
华泰证券	20230601000 23938	康泰生物	2023 年 6 月 1 日	140,400.00	5,000	14	3.40	185.64	-	-
华泰证券	20230605000 24609	康泰生物	2023 年 6 月 5 日	109,200.00	4,000	14	3.40	144.34	-	-
华泰证券	20230615000 30511	康泰生物	2023 年 6 月 15 日	127,500.00	5,000	14	3.40	168.56	-	-
华泰证券	20230619000 18120	康泰生物	2023 年 6 月 19 日	102,880.00	4,000	14	3.40	106.92	101,560.00	106.92
华泰证券	20230629000 42353	康泰生物	2023 年 6 月 29 日	124,000.00	5,000	14	3.40	11.71	126,950.00	11.71
华泰证券	20230515000 01537	科大讯飞	2023 年 5 月 15 日	159,750.00	2,500	14	3.20	198.80	-	-
华泰证券	20230516000 01268	科大讯飞	2023 年 5 月 16 日	721,264.00	12,200	14	3.20	897.54	-	-
华泰证券	20230517000 01761	科大讯飞	2023 年 5 月 17 日	2,554,854.00	43,800	14	3.20	3,179.40	-	-

华泰证券	20230525000 02820	科大讯飞	2023 年 5 月 25 日	583,905.00	10,500	14	3.20	726.60	-	-
华泰证券	20230529000 01392	科大讯飞	2023 年 5 月 29 日	1,100,048.00	19,700	14	3.20	1,368.92	-	-
华泰证券	20230529000 11101	科大讯飞	2023 年 5 月 29 日	139,600.00	2,500	14	3.20	173.74	-	-
华泰证券	20230530000 20848	科大讯飞	2023 年 5 月 30 日	734,440.00	12,200	14	3.20	913.92	-	-
华泰证券	20230531000 09153	科大讯飞	2023 年 5 月 31 日	2,617,050.00	43,800	14	3.20	3,256.82	-	-
华泰证券	20230605000 01085	科大讯飞	2023 年 6 月 5 日	187,264.00	2,800	14	3.20	233.10	-	-
华泰证券	20230608000 21675	科大讯飞	2023 年 6 月 8 日	674,205.00	10,500	14	3.20	1,078.74	-	-
华泰证券	20230612000 39026	科大讯飞	2023 年 6 月 12 日	171,250.00	2,500	14	3.20	213.08	-	-
华泰证券	20230612000 40459	科大讯飞	2023 年 6 月 12 日	1,349,450.00	19,700	14	3.20	1,679.30	-	-
华泰证券	20230613000 20266	科大讯飞	2023 年 6 月 13 日	913,170.00	12,200	14	3.20	1,136.38	-	-
华泰证券	20230614000 50406	科大讯飞	2023 年 6 月 14 日	3,290,694.00	43,800	14	3.20	4,095.14	-	-
华泰证券	20230619000 21290	科大讯飞	2023 年 6 月 19 日	211,680.00	2,800	14	3.20	207.02	190,288.00	207.02
华泰证券	20230626000 36238	科大讯飞	2023 年 6 月 26 日	761,040.00	10,500	14	3.20	270.60	713,580.00	270.60
华泰证券	20230626000 42181	科大讯飞	2023 年 6 月 26 日	1,427,856.00	19,700	14	3.20	507.68	1,338,812.00	507.68
华泰证券	20230626000 51639	科大讯飞	2023 年 6 月 26 日	181,200.00	2,500	14	3.20	64.44	169,900.00	64.44
华泰证券	20230627000 18330	科大讯飞	2023 年 6 月 27 日	883,646.00	12,200	14	3.20	235.65	829,112.00	235.65
华泰证券	20230628000 47276	科大讯飞	2023 年 6 月 28 日	3,037,530.00	43,800	14	3.20	540.00	2,976,648.00	540.00
华泰证券	20230606000 02658	科沃斯	2023 年 6 月 6 日	72,690.00	1,000	14	3.20	90.44	-	-
华泰证券	20230608000 02378	科沃斯	2023 年 6 月 8 日	3,441,240.00	47,400	14	3.20	5,506.02	-	-
华泰证券	20230620000 32266	科沃斯	2023 年 6 月 20 日	77,000.00	1,000	14	3.20	68.40	77,770.00	68.40
华泰证券	20230626000 35178	科沃斯	2023 年 6 月 26 日	3,586,284.00	47,400	14	3.20	1,275.12	3,686,298.00	1,275.12
华泰证券	20230223000	蓝思科技	2023 年 2 月	64,400.00	5,000	14	3.40	85.12	-	-

	00585		23 日							
华泰证券	20230309000 06532	蓝思科技	2023 年 3 月 9 日	62,600.00	5,000	14	3.40	82.74	-	-
华泰证券	20230323000 07024	蓝思科技	2023 年 3 月 23 日	67,800.00	5,000	14	3.40	89.60	-	-
华泰证券	20230406000 13018	蓝思科技	2023 年 4 月 6 日	69,400.00	5,000	14	3.40	91.70	-	-
华泰证券	20230420000 09143	蓝思科技	2023 年 4 月 20 日	66,500.00	5,000	14	3.40	87.92	-	-
华泰证券	20230504000 17465	蓝思科技	2023 年 5 月 4 日	58,450.00	5,000	14	3.40	77.28	-	-
华泰证券	20230518000 40718	蓝思科技	2023 年 5 月 18 日	58,250.00	5,000	14	3.40	77.00	-	-
华泰证券	20230601000 26315	蓝思科技	2023 年 6 月 1 日	58,150.00	5,000	14	3.40	76.86	-	-
华泰证券	20230615000 30001	蓝思科技	2023 年 6 月 15 日	58,500.00	5,000	14	3.40	77.42	-	-
华泰证券	20230629000 39248	蓝思科技	2023 年 6 月 29 日	58,600.00	5,000	14	3.40	5.53	58,800.00	5.53
华泰证券	20230103000 26091	澜起科技	2023 年 1 月 3 日	3,755,400.00	60,000	14	3.40	4,965.52	-	-
华泰证券	20230111000 00229	澜起科技	2023 年 1 月 11 日	6,213,675.00	97,500	14	3.40	11,150.15	-	-
华泰证券	20230117000 31733	澜起科技	2023 年 1 月 17 日	3,728,400.00	60,000	14	3.40	4,929.82	-	-
华泰证券	20230130000 72117	澜起科技	2023 年 1 月 30 日	5,834,400.00	97,500	14	3.40	7,714.42	-	-
华泰证券	20230131000 27089	澜起科技	2023 年 1 月 31 日	3,324,600.00	60,000	14	3.40	4,395.86	-	-
华泰证券	20230213000 78192	澜起科技	2023 年 2 月 13 日	6,127,875.00	97,500	14	3.40	8,102.36	-	-
华泰证券	20230214000 24013	澜起科技	2023 年 2 月 14 日	3,768,000.00	60,000	14	3.40	4,982.18	-	-
华泰证券	20230227000 00573	澜起科技	2023 年 2 月 27 日	2,900,000.00	50,000	14	3.40	3,834.46	-	-
华泰证券	20230227000 64364	澜起科技	2023 年 2 月 27 日	5,655,000.00	97,500	14	3.40	7,477.12	-	-
华泰证券	20230313000 63370	澜起科技	2023 年 3 月 13 日	2,776,000.00	50,000	14	3.40	3,670.52	-	-
华泰证券	20230313000 65496	澜起科技	2023 年 3 月 13 日	5,413,200.00	97,500	14	3.40	7,157.50	-	-
华泰证券	20230327000 69519	澜起科技	2023 年 3 月 27 日	6,687,525.00	97,500	14	3.40	8,842.40	-	-

华泰证券	2023032700069941	澜起科技	2023 年 3 月 27 日	3,429,500.00	50,000	14	3.40	4,534.60	-	-
华泰证券	2023041000058625	澜起科技	2023 年 4 月 10 日	3,585,000.00	50,000	14	3.40	4,740.12	-	-
华泰证券	2023041000060381	澜起科技	2023 年 4 月 10 日	6,990,750.00	97,500	14	3.40	9,243.36	-	-
华泰证券	2023042400032867	澜起科技	2023 年 4 月 24 日	6,747,000.00	97,500	14	3.40	8,921.08	-	-
华泰证券	2023042400039453	澜起科技	2023 年 4 月 24 日	3,460,000.00	50,000	14	3.40	4,574.92	-	-
华泰证券	2023050800018331	澜起科技	2023 年 5 月 8 日	5,792,475.00	97,500	14	3.40	7,658.98	-	-
华泰证券	2023050800031983	澜起科技	2023 年 5 月 8 日	2,970,500.00	50,000	14	3.40	3,927.70	-	-
华泰证券	2023052200029658	澜起科技	2023 年 5 月 22 日	2,970,500.00	50,000	14	3.40	3,927.70	-	-
华泰证券	2023052200039318	澜起科技	2023 年 5 月 22 日	5,792,475.00	97,500	14	3.40	7,658.98	-	-
华泰证券	2023060500001042	澜起科技	2023 年 6 月 5 日	3,014,000.00	50,000	14	3.40	3,985.24	-	-
华泰证券	2023060500027396	澜起科技	2023 年 6 月 5 日	5,877,300.00	97,500	14	3.40	7,771.12	-	-
华泰证券	2023061900019572	澜起科技	2023 年 6 月 19 日	3,105,500.00	50,000	14	3.40	3,226.30	2,871,000.00	3,226.30
华泰证券	2023061900022914	澜起科技	2023 年 6 月 19 日	6,055,725.00	97,500	14	3.40	6,291.23	5,598,450.00	6,291.23
华泰证券	2023052200001197	浪潮信息	2023 年 5 月 22 日	1,185,000.00	30,000	14	3.20	1,474.62	-	-
华泰证券	2023052600001374	浪潮信息	2023 年 5 月 26 日	401,386.00	9,700	14	3.50	546.28	-	-
华泰证券	2023052900001405	浪潮信息	2023 年 5 月 29 日	79,600.00	2,000	14	3.20	99.12	-	-
华泰证券	2023053000016150	浪潮信息	2023 年 5 月 30 日	131,340.00	3,000	14	3.20	163.52	-	-
华泰证券	2023053100001625	浪潮信息	2023 年 5 月 31 日	133,680.00	3,000	14	3.20	166.32	-	-
华泰证券	2023060100001706	浪潮信息	2023 年 6 月 1 日	679,350.00	15,000	14	3.20	845.46	-	-
华泰证券	2023060500001075	浪潮信息	2023 年 6 月 5 日	803,700.00	18,000	14	3.20	1,000.16	-	-
华泰证券	2023060500020411	浪潮信息	2023 年 6 月 5 日	1,339,500.00	30,000	14	3.20	1,666.98	-	-
华泰证券	20230609000	浪潮信息	2023 年 6 月 9 日	442,999.00	9,700	14	3.50	732.19	-	-

	10801		日							
华泰证券	20230612000 41678	浪潮信息	2023 年 6 月 12 日	90,460.00	2,000	14	3.20	112.56	-	-
华泰证券	20230613000 20524	浪潮信息	2023 年 6 月 13 日	147,360.00	3,000	14	3.20	183.40	-	-
华泰证券	20230614000 50490	浪潮信息	2023 年 6 月 14 日	157,500.00	3,000	14	3.20	196.00	-	-
华泰证券	20230615000 26828	浪潮信息	2023 年 6 月 15 日	780,300.00	15,000	14	3.20	971.04	-	-
华泰证券	20230619000 20469	浪潮信息	2023 年 6 月 19 日	1,864,500.00	30,000	14	3.20	1,823.03	1,455,000.00	1,823.03
华泰证券	20230619000 20535	浪潮信息	2023 年 6 月 19 日	1,118,700.00	18,000	14	3.20	1,093.84	873,000.00	1,093.84
华泰证券	20230626000 32832	浪潮信息	2023 年 6 月 26 日	113,420.00	2,000	14	3.20	40.32	97,000.00	40.32
华泰证券	20230626000 36807	浪潮信息	2023 年 6 月 26 日	550,087.00	9,700	14	3.50	213.92	470,450.00	213.92
华泰证券	20230627000 16642	浪潮信息	2023 年 6 月 27 日	169,560.00	3,000	14	3.20	45.21	145,500.00	45.21
华泰证券	20230628000 48403	浪潮信息	2023 年 6 月 28 日	152,190.00	3,000	14	3.20	27.06	145,500.00	27.06
华泰证券	20230629000 41153	浪潮信息	2023 年 6 月 29 日	720,600.00	15,000	14	3.20	64.05	727,500.00	64.05
华泰证券	20230619000 01092	龙佰集团	2023 年 6 月 19 日	6,611,072.00	397,300	14	3.20	6,464.15	6,555,450.00	6,464.15
华泰证券	20230515000 01549	龙源电力	2023 年 5 月 15 日	18,780.00	1,000	14	3.20	23.38	-	-
华泰证券	20230529000 11098	龙源电力	2023 年 5 月 29 日	20,470.00	1,000	14	3.20	25.48	-	-
华泰证券	20230606000 02632	龙源电力	2023 年 6 月 6 日	89,012.00	4,400	14	3.20	110.74	-	-
华泰证券	20230607000 02495	龙源电力	2023 年 6 月 7 日	70,945.00	3,500	14	3.20	88.34	-	-
华泰证券	20230608000 02332	龙源电力	2023 年 6 月 8 日	105,009.00	5,100	14	3.20	167.94	-	-
华泰证券	20230612000 38841	龙源电力	2023 年 6 月 12 日	20,820.00	1,000	14	3.20	25.90	-	-
华泰证券	20230620000 35919	龙源电力	2023 年 6 月 20 日	90,068.00	4,400	14	3.20	80.10	99,000.00	80.10
华泰证券	20230621000 14215	龙源电力	2023 年 6 月 21 日	72,415.00	3,500	14	3.20	57.96	78,750.00	57.96
华泰证券	20230626000 32876	龙源电力	2023 年 6 月 26 日	22,110.00	1,000	14	3.20	7.88	22,500.00	7.88

华泰证券	20230626000 36255	龙源电力	2023 年 6 月 26 日	112,761.00	5,100	14	3.20	40.08	114,750.00	40.08
华泰证券	20230104000 15088	迈为股份	2023 年 1 月 4 日	1,945,680.00	4,800	14	3.40	2,572.64	-	-
华泰证券	20230110000 17517	迈为股份	2023 年 1 月 10 日	3,651,502.00	8,300	14	3.40	6,897.20	-	-
华泰证券	20230111000 24247	迈为股份	2023 年 1 月 11 日	1,724,800.00	4,000	14	3.40	3,095.10	-	-
华泰证券	20230118000 17115	迈为股份	2023 年 1 月 18 日	2,149,776.00	4,800	14	3.40	2,842.42	-	-
华泰证券	20230130000 72161	迈为股份	2023 年 1 月 30 日	3,692,587.00	8,300	14	3.40	4,882.36	-	-
华泰证券	20230130000 74257	迈为股份	2023 年 1 月 30 日	1,779,560.00	4,000	14	3.40	2,352.98	-	-
华泰证券	20230201000 17984	迈为股份	2023 年 2 月 1 日	2,043,360.00	4,800	14	3.40	2,701.72	-	-
华泰证券	20230213000 63632	迈为股份	2023 年 2 月 13 日	1,568,000.00	4,000	14	3.40	2,073.26	-	-
华泰证券	20230213000 82924	迈为股份	2023 年 2 月 13 日	3,253,600.00	8,300	14	3.40	4,301.92	-	-
华泰证券	20230215000 15354	迈为股份	2023 年 2 月 15 日	1,790,880.00	4,800	14	3.40	2,367.96	-	-
华泰证券	20230227000 68016	迈为股份	2023 年 2 月 27 日	3,002,525.00	8,300	14	3.40	3,969.98	-	-
华泰证券	20230227000 74110	迈为股份	2023 年 2 月 27 日	1,447,000.00	4,000	14	3.40	1,913.24	-	-
华泰证券	20230301000 15871	迈为股份	2023 年 3 月 1 日	1,740,960.00	4,800	14	3.40	2,301.88	-	-
华泰证券	20230313000 69698	迈为股份	2023 年 3 月 13 日	2,826,150.00	8,300	14	3.40	3,736.74	-	-
华泰证券	20230313000 70256	迈为股份	2023 年 3 月 13 日	1,362,000.00	4,000	14	3.40	1,800.82	-	-
华泰证券	20230315000 15621	迈为股份	2023 年 3 月 15 日	1,608,432.00	4,800	14	3.40	2,126.74	-	-
华泰证券	20230327000 56573	迈为股份	2023 年 3 月 27 日	2,531,500.00	8,300	14	3.40	3,347.26	-	-
华泰证券	20230329000 16846	迈为股份	2023 年 3 月 29 日	1,451,040.00	4,800	14	3.40	1,918.56	-	-
华泰证券	20230410000 65443	迈为股份	2023 年 4 月 10 日	2,470,329.00	8,300	14	3.40	3,266.34	-	-
华泰证券	20230412000 31192	迈为股份	2023 年 4 月 12 日	1,391,040.00	4,800	14	3.40	1,839.32	-	-
华泰证券	20230424000	迈为股份	2023 年 4 月	2,249,383.00	8,300	14	3.40	2,974.16	-	-

	35637		24 日							
华泰证券	20230426000 31894	迈为股份	2023 年 4 月 26 日	1,344,240.00	4,800	14	3.40	1,777.44	-	-
华泰证券	20230508000 22815	迈为股份	2023 年 5 月 8 日	2,161,403.00	8,300	14	3.40	2,857.82	-	-
华泰证券	20230510000 08084	迈为股份	2023 年 5 月 10 日	1,267,200.00	4,800	14	3.40	1,675.52	-	-
华泰证券	20230522000 43010	迈为股份	2023 年 5 月 22 日	2,320,348.00	8,300	14	3.40	3,067.96	-	-
华泰证券	20230524000 20224	迈为股份	2023 年 5 月 24 日	1,330,992.00	4,800	14	3.40	1,759.94	-	-
华泰证券	20230605000 19983	迈为股份	2023 年 6 月 5 日	1,242,676.00	8,300	14	3.40	1,643.04	-	-
华泰证券	20230616000 02167	迈为股份	2023 年 6 月 16 日	2,873,948.00	19,600	14	3.40	3,800.02	-	-
华泰证券	20230208000 00571	芒果超媒	2023 年 2 月 8 日	4,609,016.00	135,400	14	3.40	6,094.20	-	-
华泰证券	20230223000 00587	芒果超媒	2023 年 2 月 23 日	164,600.00	5,000	14	3.40	217.70	-	-
华泰证券	20230308000 00555	芒果超媒	2023 年 3 月 8 日	1,848,678.00	51,900	14	3.40	2,444.40	-	-
华泰证券	20230309000 06530	芒果超媒	2023 年 3 月 9 日	180,500.00	5,000	14	3.40	238.70	-	-
华泰证券	20230316000 00626	芒果超媒	2023 年 3 月 16 日	704,000.00	20,000	14	3.40	930.86	-	-
华泰证券	20230322000 08343	芒果超媒	2023 年 3 月 22 日	1,909,920.00	51,900	14	3.40	2,705.70	-	-
华泰证券	20230323000 07002	芒果超媒	2023 年 3 月 23 日	183,400.00	5,000	14	3.40	242.48	-	-
华泰证券	20230330000 17469	芒果超媒	2023 年 3 月 30 日	733,800.00	20,000	14	3.40	970.20	-	-
华泰证券	20230406000 12962	芒果超媒	2023 年 4 月 6 日	2,049,012.00	51,900	14	3.40	2,709.28	-	-
华泰证券	20230406000 13006	芒果超媒	2023 年 4 月 6 日	197,400.00	5,000	14	3.40	260.96	-	-
华泰证券	20230413000 12151	芒果超媒	2023 年 4 月 13 日	792,000.00	20,000	14	3.40	1,047.20	-	-
华泰证券	20230420000 09139	芒果超媒	2023 年 4 月 20 日	1,780,170.00	51,900	14	3.40	2,353.82	-	-
华泰证券	20230420000 09141	芒果超媒	2023 年 4 月 20 日	171,500.00	5,000	14	3.40	226.80	-	-
华泰证券	20230427000 19950	芒果超媒	2023 年 4 月 27 日	689,200.00	20,000	14	3.40	911.26	-	-

华泰证券	20230504000 15347	芒果超媒	2023 年 5 月 4 日	1,937,427.00	51,900	14	3.40	2,561.72	-	-
华泰证券	20230504000 20285	芒果超媒	2023 年 5 月 4 日	186,650.00	5,000	14	3.40	246.82	-	-
华泰证券	20230511000 11519	芒果超媒	2023 年 5 月 11 日	696,400.00	20,000	14	3.40	920.78	-	-
华泰证券	20230517000 01736	芒果超媒	2023 年 5 月 17 日	425,115.00	14,100	14	3.40	562.10	-	-
华泰证券	20230518000 38876	芒果超媒	2023 年 5 月 18 日	150,500.00	5,000	14	3.40	198.94	-	-
华泰证券	20230518000 40174	芒果超媒	2023 年 5 月 18 日	1,562,190.00	51,900	14	3.40	2,065.56	-	-
华泰证券	20230525000 06744	芒果超媒	2023 年 5 月 25 日	571,000.00	20,000	14	3.40	755.02	-	-
华泰证券	20230531000 01623	芒果超媒	2023 年 5 月 31 日	1,132,362.00	38,700	14	3.40	1,497.30	-	-
华泰证券	20230531000 08273	芒果超媒	2023 年 5 月 31 日	412,566.00	14,100	14	3.40	545.44	-	-
华泰证券	20230601000 25655	芒果超媒	2023 年 6 月 1 日	1,550,772.00	51,900	14	3.40	2,050.44	-	-
华泰证券	20230601000 28876	芒果超媒	2023 年 6 月 1 日	149,400.00	5,000	14	3.40	197.54	-	-
华泰证券	20230608000 17342	芒果超媒	2023 年 6 月 8 日	622,200.00	20,000	14	3.40	1,057.68	-	-
华泰证券	20230615000 30111	芒果超媒	2023 年 6 月 15 日	2,012,163.00	51,900	14	3.40	2,660.56	-	-
华泰证券	20230615000 36236	芒果超媒	2023 年 6 月 15 日	193,850.00	5,000	14	3.40	256.34	-	-
华泰证券	20230626000 37850	芒果超媒	2023 年 6 月 26 日	721,000.00	20,000	14	3.40	272.36	684,200.00	272.36
华泰证券	20230629000 43870	芒果超媒	2023 年 6 月 29 日	1,798,335.00	51,900	14	3.40	169.84	1,775,499.00	169.84
华泰证券	20230629000 44580	芒果超媒	2023 年 6 月 29 日	173,250.00	5,000	14	3.40	16.36	171,050.00	16.36
华泰证券	20230606000 02644	明阳智能	2023 年 6 月 6 日	123,043.00	7,100	14	3.20	153.16	-	-
华泰证券	20230607000 02533	明阳智能	2023 年 6 月 7 日	111,823.00	6,700	14	3.20	139.16	-	-
华泰证券	20230612000 22796	明阳智能	2023 年 6 月 12 日	360,570.00	21,000	14	3.20	448.70	-	-
华泰证券	20230616000 02227	明阳智能	2023 年 6 月 16 日	17,270.00	1,000	14	3.20	21.56	-	-
华泰证券	20230619000	明阳智能	2023 年 6 月	93,690.00	5,400	14	3.20	91.63	91,152.00	91.63

	01088		19 日							
华泰证券	2023062000033017	明阳智能	2023 年 6 月 20 日	121,765.00	7,100	14	3.20	108.20	119,848.00	108.20
华泰证券	2023062100016488	明阳智能	2023 年 6 月 21 日	113,029.00	6,700	14	3.20	90.45	113,096.00	90.45
华泰证券	2023062600032945	明阳智能	2023 年 6 月 26 日	343,980.00	21,000	14	3.20	122.32	354,480.00	122.32
华泰证券	2023063000016542	明阳智能	2023 年 6 月 30 日	16,880.00	1,000	14	3.20	-	16,880.00	-
华泰证券	2023052900001453	南山铝业	2023 年 5 月 29 日	9,120.00	3,000	14	3.20	11.34	-	-
华泰证券	2023053100001645	南山铝业	2023 年 5 月 31 日	39,130.00	13,000	14	3.20	48.72	-	-
华泰证券	2023060500001040	南山铝业	2023 年 6 月 5 日	184,164.00	59,600	14	3.20	229.18	-	-
华泰证券	2023061200022889	南山铝业	2023 年 6 月 12 日	108,500.00	35,000	14	3.20	134.96	-	-
华泰证券	2023061200039389	南山铝业	2023 年 6 月 12 日	9,300.00	3,000	14	3.20	11.62	-	-
华泰证券	2023061900018564	南山铝业	2023 年 6 月 19 日	182,376.00	59,600	14	3.20	178.31	179,992.00	178.31
华泰证券	2023062600034663	南山铝业	2023 年 6 月 26 日	102,900.00	35,000	14	3.20	36.60	105,700.00	36.60
华泰证券	2023062600046367	南山铝业	2023 年 6 月 26 日	8,820.00	3,000	14	3.20	3.12	9,060.00	3.12
华泰证券	2023062700004525	南山铝业	2023 年 6 月 27 日	18,180.00	6,000	14	3.20	4.86	18,120.00	4.86
华泰证券	2023053000016182	农业银行	2023 年 5 月 30 日	150,850.00	43,100	7	1.80	52.78	-	-
华泰证券	2023052900001342	农业银行	2023 年 5 月 29 日	1,694,560.00	476,000	14	1.80	1,186.22	-	-
华泰证券	2023052900001411	农业银行	2023 年 5 月 29 日	573,160.00	161,000	14	1.80	401.24	-	-
华泰证券	2023060600021514	农业银行	2023 年 6 月 6 日	153,436.00	43,100	7	1.80	53.69	-	-
华泰证券	2023061300020886	农业银行	2023 年 6 月 13 日	158,177.00	43,100	7	1.80	55.37	-	-
华泰证券	2023061200023121	农业银行	2023 年 6 月 12 日	1,742,160.00	476,000	14	1.80	1,219.54	-	-
华泰证券	2023062000010260	农业银行	2023 年 6 月 20 日	150,850.00	43,100	7	1.80	52.78	-	-
华泰证券	2023062700021912	农业银行	2023 年 6 月 27 日	152,143.00	43,100	7	1.80	22.83	152,143.00	22.83

华泰证券	20230626000 47121	农业银行	2023 年 6 月 26 日	1,651,720.00	476,000	14	1.80	330.36	1,680,280.00	330.36
华泰证券	20230614000 16388	欧派家居	2023 年 6 月 14 日	788,970.00	7,800	14	3.20	981.82	-	-
华泰证券	20230628000 47035	欧派家居	2023 年 6 月 28 日	740,922.00	7,800	14	3.20	131.72	747,240.00	131.72
华泰证券	20230103000 27989	欧普康视	2023 年 1 月 3 日	312,210.00	9,000	14	3.40	412.86	-	-
华泰证券	20230103000 28137	欧普康视	2023 年 1 月 3 日	1,921,826.00	55,400	14	3.40	2,541.14	-	-
华泰证券	20230103000 28139	欧普康视	2023 年 1 月 3 日	104,070.00	3,000	14	3.40	137.62	-	-
华泰证券	20230103000 28141	欧普康视	2023 年 1 月 3 日	360,776.00	10,400	14	3.40	476.98	-	-
华泰证券	20230104000 15054	欧普康视	2023 年 1 月 4 日	1,033,850.00	29,000	14	3.40	1,366.96	-	-
华泰证券	20230104000 15056	欧普康视	2023 年 1 月 4 日	106,950.00	3,000	14	3.40	141.40	-	-
华泰证券	20230105000 17559	欧普康视	2023 年 1 月 5 日	251,650.00	7,000	14	3.40	332.78	-	-
华泰证券	20230105000 17561	欧普康视	2023 年 1 月 5 日	179,750.00	5,000	14	3.40	237.72	-	-
华泰证券	20230106000 09118	欧普康视	2023 年 1 月 6 日	213,360.00	6,000	14	3.40	282.10	-	-
华泰证券	20230106000 09120	欧普康视	2023 年 1 月 6 日	2,460,752.00	69,200	14	3.40	3,253.60	-	-
华泰证券	20230117000 32539	欧普康视	2023 年 1 月 17 日	2,143,980.00	55,400	14	3.40	2,834.86	-	-
华泰证券	20230118000 17051	欧普康视	2023 年 1 月 18 日	1,088,950.00	29,000	14	3.40	1,439.90	-	-
华泰证券	20230118000 17053	欧普康视	2023 年 1 月 18 日	112,650.00	3,000	14	3.40	148.96	-	-
华泰证券	20230119000 13134	欧普康视	2023 年 1 月 19 日	267,190.00	7,000	14	3.40	353.22	-	-
华泰证券	20230119000 13136	欧普康视	2023 年 1 月 19 日	190,850.00	5,000	14	3.40	252.42	-	-
华泰证券	20230120000 07293	欧普康视	2023 年 1 月 20 日	225,900.00	6,000	14	3.40	298.76	-	-
华泰证券	20230120000 07295	欧普康视	2023 年 1 月 20 日	2,605,380.00	69,200	14	3.40	3,444.84	-	-
华泰证券	20230131000 32357	欧普康视	2023 年 1 月 31 日	2,051,462.00	55,400	14	3.40	2,712.50	-	-
华泰证券	20230203000	欧普康视	2023 年 2 月 3	221,520.00	6,000	14	3.40	292.88	-	-

	11180		日							
华泰证券	20230203000 11182	欧普康视	2023 年 2 月 3 日	2,554,864.00	69,200	14	3.40	3,378.06	-	-
华泰证券	20230214000 23913	欧普康视	2023 年 2 月 14 日	2,071,960.00	55,400	14	3.40	2,739.66	-	-
华泰证券	20230217000 19886	欧普康视	2023 年 2 月 17 日	209,100.00	6,000	14	3.40	276.50	-	-
华泰证券	20230217000 19888	欧普康视	2023 年 2 月 17 日	2,411,620.00	69,200	14	3.40	3,188.64	-	-
华泰证券	20230223000 00593	欧普康视	2023 年 2 月 23 日	175,200.00	5,000	14	3.40	231.70	-	-
华泰证券	20230228000 23900	欧普康视	2023 年 2 月 28 日	1,908,530.00	55,400	14	3.40	2,523.50	-	-
华泰证券	20230303000 10045	欧普康视	2023 年 3 月 3 日	202,740.00	6,000	14	3.40	268.10	-	-
华泰证券	20230309000 06524	欧普康视	2023 年 3 月 9 日	164,500.00	5,000	14	3.40	217.56	-	-
华泰证券	20230314000 19494	欧普康视	2023 年 3 月 14 日	1,816,012.00	55,400	14	3.40	2,401.14	-	-
华泰证券	20230315000 01235	欧普康视	2023 年 3 月 15 日	97,560.00	3,000	14	3.40	128.94	-	-
华泰证券	20230323000 05900	欧普康视	2023 年 3 月 23 日	164,200.00	5,000	14	3.40	217.14	-	-
华泰证券	20230328000 23923	欧普康视	2023 年 3 月 28 日	1,858,116.00	55,400	14	3.40	2,456.86	-	-
华泰证券	20230406000 12938	欧普康视	2023 年 4 月 6 日	165,900.00	5,000	14	3.40	219.38	-	-
华泰证券	20230411000 17720	欧普康视	2023 年 4 月 11 日	1,999,940.00	55,400	14	3.40	2,644.32	-	-
华泰证券	20230420000 09155	欧普康视	2023 年 4 月 20 日	165,500.00	5,000	14	3.40	218.82	-	-
华泰证券	20230425000 59025	欧普康视	2023 年 4 月 25 日	1,733,466.00	55,400	14	3.40	2,292.08	-	-
华泰证券	20230504000 37837	欧普康视	2023 年 5 月 4 日	160,850.00	5,000	14	3.40	212.66	-	-
华泰证券	20230518000 40028	欧普康视	2023 年 5 月 18 日	148,350.00	5,000	14	3.40	196.14	-	-
华泰证券	20230223000 00547	奇安信	2023 年 2 月 23 日	368,450.00	5,000	14	3.40	487.20	-	-
华泰证券	20230228000 00771	奇安信	2023 年 2 月 28 日	3,803,000.00	50,000	14	3.40	5,028.38	-	-
华泰证券	20230301000 01142	奇安信	2023 年 3 月 1 日	784,000.00	10,000	14	3.40	1,036.56	-	-

华泰证券	20230309000 06488	奇安信	2023 年 3 月 9 日	385,000.00	5,000	14	3.40	509.04	-	-
华泰证券	20230314000 19490	奇安信	2023 年 3 月 14 日	3,926,000.00	50,000	14	3.40	5,191.06	-	-
华泰证券	20230315000 15603	奇安信	2023 年 3 月 15 日	703,200.00	10,000	14	3.40	929.74	-	-
华泰证券	20230323000 06982	奇安信	2023 年 3 月 23 日	345,200.00	5,000	14	3.40	456.40	-	-
华泰证券	20230406000 13762	奇安信	2023 年 4 月 6 日	390,350.00	5,000	14	3.40	516.18	-	-
华泰证券	20230420000 05381	奇安信	2023 年 4 月 20 日	360,750.00	5,000	14	3.40	476.98	-	-
华泰证券	20230504000 33547	奇安信	2023 年 5 月 4 日	287,050.00	5,000	14	3.40	379.54	-	-
华泰证券	20230518000 40074	奇安信	2023 年 5 月 18 日	280,400.00	5,000	14	3.40	370.72	-	-
华泰证券	20230519000 02299	奇安信	2023 年 5 月 19 日	333,600.00	6,000	14	3.40	441.14	-	-
华泰证券	20230601000 29751	奇安信	2023 年 6 月 1 日	290,050.00	5,000	14	3.40	383.46	-	-
华泰证券	20230602000 11828	奇安信	2023 年 6 月 2 日	352,140.00	6,000	14	3.40	465.64	-	-
华泰证券	20230615000 30938	奇安信	2023 年 6 月 15 日	289,150.00	5,000	14	3.40	382.34	-	-
华泰证券	20230616000 17723	奇安信	2023 年 6 月 16 日	358,020.00	6,000	14	3.40	473.34	-	-
华泰证券	20230626000 01445	奇安信	2023 年 6 月 26 日	170,839.00	2,900	14	3.40	64.56	150,249.00	64.56
华泰证券	20230629000 43058	奇安信	2023 年 6 月 29 日	264,900.00	5,000	14	3.40	25.02	259,050.00	25.02
华泰证券	20230630000 15761	奇安信	2023 年 6 月 30 日	310,860.00	6,000	14	3.40	-	310,860.00	-
华泰证券	20230518000 01302	青岛啤酒	2023 年 5 月 18 日	207,400.00	2,000	14	3.20	258.16	-	-
华泰证券	20230531000 01649	青岛啤酒	2023 年 5 月 31 日	466,529.00	4,900	14	3.20	580.58	-	-
华泰证券	20230614000 48779	青岛啤酒	2023 年 6 月 14 日	504,602.00	4,900	14	3.20	627.90	-	-
华泰证券	20230628000 42166	青岛啤酒	2023 年 6 月 28 日	502,054.00	4,900	14	3.20	89.26	507,787.00	89.26
华泰证券	20230613000 02605	荣盛石化	2023 年 6 月 13 日	73,332.00	6,300	14	3.20	91.28	-	-
华泰证券	20230629000	荣盛石化	2023 年 6 月	95,367.00	8,300	14	3.20	8.48	96,612.00	8.48

	07821		29 日							
华泰证券	20230630000 01476	荣盛石化	2023 年 6 月 30 日	132,696.00	11,400	14	3.20	-	132,696.00	-
华泰证券	20230223000 00553	容百科技	2023 年 2 月 23 日	364,700.00	5,000	14	3.40	482.16	-	-
华泰证券	20230309000 06496	容百科技	2023 年 3 月 9 日	338,500.00	5,000	14	3.40	447.58	-	-
华泰证券	20230323000 06992	容百科技	2023 年 3 月 23 日	367,000.00	5,000	14	3.40	485.24	-	-
华泰证券	20230406000 13758	容百科技	2023 年 4 月 6 日	356,550.00	5,000	14	3.40	471.38	-	-
华泰证券	20230420000 05375	容百科技	2023 年 4 月 20 日	337,050.00	5,000	14	3.40	445.62	-	-
华泰证券	20230504000 36705	容百科技	2023 年 5 月 4 日	334,500.00	5,000	14	3.40	442.26	-	-
华泰证券	20230518000 40232	容百科技	2023 年 5 月 18 日	315,450.00	5,000	14	3.40	417.06	-	-
华泰证券	20230601000 29947	容百科技	2023 年 6 月 1 日	290,700.00	5,000	14	3.40	384.44	-	-
华泰证券	20230613000 02635	容百科技	2023 年 6 月 13 日	5,321,000.00	100,000	14	3.40	7,035.56	-	-
华泰证券	20230615000 03690	容百科技	2023 年 6 月 15 日	1,706,670.00	31,500	14	3.40	2,256.66	-	-
华泰证券	20230615000 32116	容百科技	2023 年 6 月 15 日	270,900.00	5,000	14	3.40	358.26	-	-
华泰证券	20230616000 02222	容百科技	2023 年 6 月 16 日	214,680.00	4,000	14	3.40	283.92	-	-
华泰证券	20230612000 22786	容百科技	2023 年 6 月 12 日	136,650.00	2,500	28	3.40	232.38	135,050.00	232.38
华泰证券	20230626000 01453	容百科技	2023 年 6 月 26 日	261,150.00	5,000	14	3.40	98.64	270,100.00	98.64
华泰证券	20230627000 20931	容百科技	2023 年 6 月 27 日	5,115,000.00	100,000	14	3.40	1,449.24	5,402,000.00	1,449.24
华泰证券	20230614000 16406	容百科技	2023 年 6 月 14 日	2,062,764.00	39,600	28	3.40	3,117.12	2,139,192.00	3,117.12
华泰证券	20230629000 39337	容百科技	2023 年 6 月 29 日	258,550.00	5,000	14	3.40	24.42	270,100.00	24.42
华泰证券	20230629000 44253	容百科技	2023 年 6 月 29 日	1,628,865.00	31,500	14	3.40	153.84	1,701,630.00	153.84
华泰证券	20230630000 18654	容百科技	2023 年 6 月 30 日	216,080.00	4,000	14	3.40	-	216,080.00	-
华泰证券	20230628000 04406	三花智控	2023 年 6 月 28 日	7,748,000.00	260,000	14	3.20	1,377.42	7,867,600.00	1,377.42

华泰证券	20230629000 07819	三花智控	2023 年 6 月 29 日	9,210,000.00	300,000	14	3.20	818.67	9,078,000. 00	818.67
华泰证券	20230630000 01482	三花智控	2023 年 6 月 30 日	6,052,000.00	200,000	14	3.20	—	6,052,000. 00	—
华泰证券	20230223000 00565	三环集团	2023 年 2 月 23 日	161,200.00	5,000	14	3.40	213.08	—	—
华泰证券	20230309000 06528	三环集团	2023 年 3 月 9 日	153,800.00	5,000	14	3.40	203.42	—	—
华泰证券	20230323000 07000	三环集团	2023 年 3 月 23 日	151,850.00	5,000	14	3.40	200.76	—	—
华泰证券	20230406000 13004	三环集团	2023 年 4 月 6 日	163,800.00	5,000	14	3.40	216.58	—	—
华泰证券	20230420000 09137	三环集团	2023 年 4 月 20 日	162,750.00	5,000	14	3.40	215.18	—	—
华泰证券	20230504000 32725	三环集团	2023 年 5 月 4 日	150,800.00	5,000	14	3.40	199.36	—	—
华泰证券	20230518000 40242	三环集团	2023 年 5 月 18 日	148,750.00	5,000	14	3.40	196.70	—	—
华泰证券	20230601000 26194	三环集团	2023 年 6 月 1 日	150,400.00	5,000	14	3.40	198.80	—	—
华泰证券	20230615000 27228	三环集团	2023 年 6 月 15 日	148,000.00	5,000	14	3.40	195.72	—	—
华泰证券	20230629000 42624	三环集团	2023 年 6 月 29 日	146,650.00	5,000	14	3.40	13.85	146,750.00	13.85
华泰证券	20230612000 23123	三六零	2023 年 6 月 12 日	2,975,778.00	204,100	14	3.20	3,703.14	—	—
华泰证券	20230615000 03698	三六零	2023 年 6 月 15 日	663,040.00	44,800	14	3.20	825.16	—	—
华泰证券	20230616000 02237	三六零	2023 年 6 月 16 日	469,340.00	31,000	14	3.20	584.08	—	—
华泰证券	20230619000 01098	三六零	2023 年 6 月 19 日	269,820.00	18,000	14	3.20	263.78	225,720.00	263.78
华泰证券	20230620000 10336	三六零	2023 年 6 月 20 日	47,610.00	3,000	14	3.20	42.30	37,620.00	42.30
华泰证券	20230621000 01962	三六零	2023 年 6 月 21 日	3,369,500.00	230,000	14	3.20	2,695.59	2,884,200. 00	2,695.59
华泰证券	20230626000 01441	三六零	2023 年 6 月 26 日	171,470.00	13,000	14	3.20	60.96	163,020.00	60.96
华泰证券	20230626000 34938	三六零	2023 年 6 月 26 日	2,692,079.00	204,100	14	3.20	957.20	2,559,414. 00	957.20
华泰证券	20230627000 04567	三六零	2023 年 6 月 27 日	262,600.00	20,000	14	3.20	70.02	250,800.00	70.02
华泰证券	20230629000	三六零	2023 年 6 月	37,560.00	3,000	14	3.20	3.34	37,620.00	3.34

	07855		29 日							
华泰证券	20230629000 38674	三六零	2023 年 6 月 29 日	560,896.00	44,800	14	3.20	49.86	561,792.00	49.86
华泰证券	20230630000 21610	三六零	2023 年 6 月 30 日	388,740.00	31,000	14	3.20	-	388,740.00	-
华泰证券	20230511000 01766	三七互娱	2023 年 5 月 11 日	3,010,000.00	100,000	14	3.50	4,096.96	-	-
华泰证券	20230515000 01535	三七互娱	2023 年 5 月 15 日	1,330,000.00	47,500	14	3.20	1,655.08	-	-
华泰证券	20230518000 01286	三七互娱	2023 年 5 月 18 日	329,230.00	11,000	14	3.20	409.78	-	-
华泰证券	20230524000 01867	三七互娱	2023 年 5 月 24 日	1,311,498.00	44,700	14	3.20	1,632.12	-	-
华泰证券	20230525000 06622	三七互娱	2023 年 5 月 25 日	2,806,000.00	100,000	14	3.50	3,819.34	-	-
华泰证券	20230529000 11100	三七互娱	2023 年 5 月 29 日	1,396,500.00	47,500	14	3.20	1,737.82	-	-
华泰证券	20230530000 16152	三七互娱	2023 年 5 月 30 日	2,293,147.00	73,100	14	3.20	2,853.76	-	-
华泰证券	20230601000 25589	三七互娱	2023 年 6 月 1 日	354,090.00	11,000	14	3.20	440.72	-	-
华泰证券	20230605000 01062	三七互娱	2023 年 6 月 5 日	544,921.00	16,700	14	3.40	720.58	-	-
华泰证券	20230607000 20367	三七互娱	2023 年 6 月 7 日	1,398,216.00	44,700	14	3.20	1,740.06	-	-
华泰证券	20230608000 22322	三七互娱	2023 年 6 月 8 日	3,110,000.00	100,000	14	3.50	5,442.48	-	-
华泰证券	20230612000 22640	三七互娱	2023 年 6 月 12 日	64,999.00	1,900	14	3.20	80.92	-	-
华泰证券	20230612000 41162	三七互娱	2023 年 6 月 12 日	1,624,975.00	47,500	14	3.20	2,022.16	-	-
华泰证券	20230613000 02609	三七互娱	2023 年 6 月 13 日	2,697,850.00	79,000	14	3.20	3,357.34	-	-
华泰证券	20230613000 19503	三七互娱	2023 年 6 月 13 日	2,496,365.00	73,100	14	3.20	3,106.60	-	-
华泰证券	20230615000 28703	三七互娱	2023 年 6 月 15 日	378,400.00	11,000	14	3.20	470.96	-	-
华泰证券	20230616000 02177	三七互娱	2023 年 6 月 16 日	381,480.00	11,000	14	3.20	474.74	-	-
华泰证券	20230619000 01090	三七互娱	2023 年 6 月 19 日	292,480.00	8,000	14	3.20	286.00	279,040.00	286.00
华泰证券	20230619000 18716	三七互娱	2023 年 6 月 19 日	610,552.00	16,700	14	3.40	634.26	582,496.00	634.26

华泰证券	2023062000010264	三七互娱	2023 年 6 月 20 日	36,940.00	1,000	14	3.20	32.80	34,880.00	32.80
华泰证券	2023062100016020	三七互娱	2023 年 6 月 21 日	1,486,275.00	44,700	14	3.20	1,188.99	1,559,136.00	1,188.99
华泰证券	2023062600038952	三七互娱	2023 年 6 月 26 日	1,491,975.00	47,500	14	3.20	530.48	1,656,800.00	530.48
华泰证券	2023062600043311	三七互娱	2023 年 6 月 26 日	3,141,000.00	100,000	14	3.50	1,221.52	3,488,000.00	1,221.52
华泰证券	2023062600051300	三七互娱	2023 年 6 月 26 日	59,679.00	1,900	14	3.20	21.24	66,272.00	21.24
华泰证券	2023062700004523	三七互娱	2023 年 6 月 27 日	1,126,921.00	34,900	14	3.20	300.51	1,217,312.00	300.51
华泰证券	2023062700016487	三七互娱	2023 年 6 月 27 日	2,360,399.00	73,100	14	3.20	629.43	2,549,728.00	629.43
华泰证券	2023062700021889	三七互娱	2023 年 6 月 27 日	2,550,910.00	79,000	14	3.20	680.25	2,755,520.00	680.25
华泰证券	2023062900040362	三七互娱	2023 年 6 月 29 日	380,380.00	11,000	14	3.20	33.81	383,680.00	33.81
华泰证券	2023063000021368	三七互娱	2023 年 6 月 30 日	383,680.00	11,000	14	3.20	-	383,680.00	-
华泰证券	2023061600002181	山西焦煤	2023 年 6 月 16 日	2,110,000.00	200,000	14	3.20	2,625.84	-	-
华泰证券	2023063000019786	山西焦煤	2023 年 6 月 30 日	1,820,000.00	200,000	14	3.20	-	1,820,000.00	-
华泰证券	2023060800002346	杉杉股份	2023 年 6 月 8 日	707,531.00	49,100	14	3.20	1,132.02	-	-
华泰证券	2023061200023051	杉杉股份	2023 年 6 月 12 日	21,765.00	1,500	14	3.20	27.16	-	-
华泰证券	2023061300002623	杉杉股份	2023 年 6 月 13 日	58,160.00	4,000	14	3.20	72.38	-	-
华泰证券	2023061400016384	杉杉股份	2023 年 6 月 14 日	114,720.00	8,000	14	3.20	142.80	-	-
华泰证券	2023062800036450	杉杉股份	2023 年 6 月 28 日	117,920.00	8,000	14	3.20	20.96	121,120.00	20.96
华泰证券	2023060200001061	深南电路	2023 年 6 月 2 日	223,735.00	2,900	14	3.20	278.46	-	-
华泰证券	2023061600020909	深南电路	2023 年 6 月 16 日	230,463.00	2,900	14	3.20	286.86	-	-
华泰证券	2023063000021276	深南电路	2023 年 6 月 30 日	218,573.00	2,900	14	3.20	-	218,573.00	-
华泰证券	2023060700002535	生益科技	2023 年 6 月 7 日	411,600.00	28,000	14	3.20	512.26	-	-
华泰证券	20230621000	生益科技	2023 年 6 月	408,520.00	28,000	14	3.20	326.79	397,600.00	326.79

	16007		21 日							
华泰证券	202301090000591	圣邦股份	2023 年 1 月 9 日	1,168,090.00	7,000	14	3.40	2,316.72	-	-
华泰证券	2023011200015781	圣邦股份	2023 年 1 月 12 日	162,260.00	1,000	14	3.40	275.76	-	-
华泰证券	2023011300008386	圣邦股份	2023 年 1 月 13 日	909,440.00	5,600	14	3.40	1,460.13	-	-
华泰证券	2023011300008434	圣邦股份	2023 年 1 月 13 日	2,143,680.00	13,200	14	3.40	3,441.82	-	-
华泰证券	2023013000069155	圣邦股份	2023 年 1 月 30 日	1,337,070.00	7,000	14	3.40	1,767.92	-	-
华泰证券	2023013000070749	圣邦股份	2023 年 1 月 30 日	2,521,332.00	13,200	14	3.40	3,333.82	-	-
华泰证券	2023013000072029	圣邦股份	2023 年 1 月 30 日	1,069,656.00	5,600	14	3.40	1,414.28	-	-
华泰证券	2023013000074227	圣邦股份	2023 年 1 月 30 日	191,010.00	1,000	14	3.40	252.56	-	-
华泰证券	2023021300059664	圣邦股份	2023 年 2 月 13 日	1,219,750.00	7,000	14	3.40	1,612.80	-	-
华泰证券	2023021300063626	圣邦股份	2023 年 2 月 13 日	2,300,100.00	13,200	14	3.40	3,041.22	-	-
华泰证券	2023022700066664	圣邦股份	2023 年 2 月 27 日	1,124,200.00	7,000	14	3.40	1,486.38	-	-
华泰证券	2023022700072506	圣邦股份	2023 年 2 月 27 日	2,119,920.00	13,200	14	3.40	2,803.08	-	-
华泰证券	2023031300068940	圣邦股份	2023 年 3 月 13 日	1,976,040.00	13,200	14	3.40	2,612.82	-	-
华泰证券	2023031300070300	圣邦股份	2023 年 3 月 13 日	1,047,900.00	7,000	14	3.40	1,385.58	-	-
华泰证券	2023032700068749	圣邦股份	2023 年 3 月 27 日	1,035,790.00	7,000	14	3.40	1,369.48	-	-
华泰证券	2023032700069857	圣邦股份	2023 年 3 月 27 日	1,953,204.00	13,200	14	3.40	2,582.58	-	-
华泰证券	2023041000064911	圣邦股份	2023 年 4 月 10 日	1,131,550.00	7,000	14	3.40	1,496.18	-	-
华泰证券	2023041000064963	圣邦股份	2023 年 4 月 10 日	2,133,780.00	13,200	14	3.40	2,821.28	-	-
华泰证券	2023042400050895	圣邦股份	2023 年 4 月 24 日	1,687,620.00	13,200	14	3.40	2,231.46	-	-
华泰证券	2023042400057883	圣邦股份	2023 年 4 月 24 日	894,950.00	7,000	14	3.40	1,183.28	-	-
华泰证券	2023050800026299	圣邦股份	2023 年 5 月 8 日	1,629,540.00	13,200	14	3.40	2,154.60	-	-

华泰证券	2023050800056397	圣邦股份	2023 年 5 月 8 日	864,150.00	7,000	14	3.40	1,142.54	-	-
华泰证券	2023051800001274	圣邦股份	2023 年 5 月 18 日	1,198,400.00	10,000	14	3.40	1,584.52	-	-
华泰证券	2023052200033316	圣邦股份	2023 年 5 月 22 日	1,534,104.00	13,200	14	3.40	2,028.46	-	-
华泰证券	2023052200040902	圣邦股份	2023 年 5 月 22 日	813,540.00	7,000	14	3.40	1,075.62	-	-
华泰证券	2023060100023734	圣邦股份	2023 年 6 月 1 日	1,096,100.00	10,000	14	3.40	1,449.28	-	-
华泰证券	2023060500028633	圣邦股份	2023 年 6 月 5 日	746,970.00	7,000	14	3.40	987.70	-	-
华泰证券	2023060500028635	圣邦股份	2023 年 6 月 5 日	1,408,572.00	13,200	14	3.40	1,862.42	-	-
华泰证券	2023061500026878	圣邦股份	2023 年 6 月 15 日	1,114,500.00	10,000	14	3.40	1,473.64	-	-
华泰证券	2023061900022406	圣邦股份	2023 年 6 月 19 日	614,040.00	7,000	14	3.40	637.89	574,910.00	637.89
华泰证券	2023062000010258	圣邦股份	2023 年 6 月 20 日	1,035,720.00	12,000	14	3.40	978.20	985,560.00	978.20
华泰证券	2023062900042406	圣邦股份	2023 年 6 月 29 日	826,800.00	10,000	14	3.40	78.09	821,300.00	78.09
华泰证券	2023022300000537	时代电气	2023 年 2 月 23 日	256,150.00	5,000	14	3.40	338.66	-	-
华泰证券	2023030900006482	时代电气	2023 年 3 月 9 日	273,850.00	5,000	14	3.40	362.04	-	-
华泰证券	2023032300006976	时代电气	2023 年 3 月 23 日	256,650.00	5,000	14	3.40	339.36	-	-
华泰证券	2023040600013748	时代电气	2023 年 4 月 6 日	252,250.00	5,000	14	3.40	333.48	-	-
华泰证券	2023042000012623	时代电气	2023 年 4 月 20 日	241,900.00	5,000	14	3.40	319.90	-	-
华泰证券	2023050400027313	时代电气	2023 年 5 月 4 日	239,900.00	5,000	14	3.40	317.24	-	-
华泰证券	2023051800039082	时代电气	2023 年 5 月 18 日	235,650.00	5,000	14	3.40	311.64	-	-
华泰证券	2023060100026287	时代电气	2023 年 6 月 1 日	221,750.00	5,000	14	3.40	293.16	-	-
华泰证券	2023061500036524	时代电气	2023 年 6 月 15 日	212,050.00	5,000	14	3.40	280.42	-	-
华泰证券	2023061200023181	时代电气	2023 年 6 月 12 日	118,888.00	2,800	28	3.40	202.14	117,208.00	202.14
华泰证券	20230629000	时代电气	2023 年 6 月	209,350.00	5,000	14	3.40	19.77	209,300.00	19.77

	45125		29 日							
华泰证券	20230413000 00936	士兰微	2023 年 4 月 13 日	6,121,220.00	161,000	14	3.20	7,617.54	-	-
华泰证券	20230427000 21362	士兰微	2023 年 4 月 27 日	5,280,800.00	161,000	14	3.20	6,571.60	-	-
华泰证券	20230511000 11391	士兰微	2023 年 5 月 11 日	5,478,830.00	161,000	14	3.20	6,818.14	-	-
华泰证券	20230522000 01209	士兰微	2023 年 5 月 22 日	662,272.00	19,900	14	3.20	824.18	-	-
华泰证券	20230525000 25858	士兰微	2023 年 5 月 25 日	5,321,050.00	161,000	14	3.20	6,621.72	-	-
华泰证券	20230516000 01284	士兰微	2023 年 5 月 16 日	1,164,450.00	35,000	28	3.20	2,898.28	-	-
华泰证券	20230605000 19776	士兰微	2023 年 6 月 5 日	635,606.00	19,900	14	3.20	791.00	-	-
华泰证券	20230608000 25859	士兰微	2023 年 6 月 8 日	4,817,120.00	161,000	14	3.20	7,707.42	-	-
华泰证券	20230619000 18431	士兰微	2023 年 6 月 19 日	615,507.00	19,900	14	3.20	601.81	602,373.00	601.81
华泰证券	20230626000 42559	士兰微	2023 年 6 月 26 日	4,825,170.00	161,000	14	3.20	1,715.60	4,873,470.00	1,715.60
华泰证券	20230613000 19729	士兰微	2023 年 6 月 13 日	1,072,750.00	35,000	28	3.20	1,621.12	1,059,450.00	1,621.12
华泰证券	20230628000 04426	士兰微	2023 年 6 月 28 日	38,532.00	1,300	14	3.20	6.86	39,351.00	6.86
华泰证券	20230509000 02199	世纪华通	2023 年 5 月 9 日	1,156,000.00	200,000	14	3.20	1,438.64	-	-
华泰证券	20230523000 05740	世纪华通	2023 年 5 月 23 日	1,086,000.00	200,000	14	3.20	1,351.42	-	-
华泰证券	20230529000 01406	双汇发展	2023 年 5 月 29 日	248,000.00	10,000	14	3.20	308.56	-	-
华泰证券	20230531000 01637	双汇发展	2023 年 5 月 31 日	54,076.00	2,200	14	3.20	67.34	-	-
华泰证券	20230612000 22671	双汇发展	2023 年 6 月 12 日	54,714.00	2,200	14	3.20	68.04	-	-
华泰证券	20230614000 51330	双汇发展	2023 年 6 月 14 日	54,780.00	2,200	14	3.20	68.18	-	-
华泰证券	20230626000 40459	双汇发展	2023 年 6 月 26 日	53,504.00	2,200	14	3.20	19.04	53,878.00	19.04
华泰证券	20230628000 54330	双汇发展	2023 年 6 月 28 日	53,900.00	2,200	14	3.20	9.58	53,878.00	9.58
华泰证券	20230531000 01627	顺丰控股	2023 年 5 月 31 日	99,393.00	2,100	14	3.20	123.76	-	-

华泰证券	2023061400049507	顺丰控股	2023 年 6 月 14 日	103,194.00	2,100	14	3.20	128.38	-	-
华泰证券	2023061600002179	顺丰控股	2023 年 6 月 16 日	627,102.00	12,600	14	3.20	780.36	-	-
华泰证券	2023060800002364	拓普集团	2023 年 6 月 8 日	1,284,305.00	20,900	14	3.20	2,054.88	-	-
华泰证券	2023061600002244	拓普集团	2023 年 6 月 16 日	899,160.00	11,800	14	3.20	1,119.02	-	-
华泰证券	2023061900001096	拓普集团	2023 年 6 月 19 日	234,000.00	3,000	14	3.20	228.80	242,100.00	228.80
华泰证券	2023062100001964	拓普集团	2023 年 6 月 21 日	1,101,660.00	14,000	14	3.20	881.37	1,129,800.00	881.37
华泰证券	20230626000043983	拓普集团	2023 年 6 月 26 日	1,596,760.00	20,900	14	3.20	567.72	1,686,630.00	567.72
华泰证券	20230630000016543	拓普集团	2023 年 6 月 30 日	952,260.00	11,800	14	3.20	-	952,260.00	-
华泰证券	20230216000000546	泰格医药	2023 年 2 月 16 日	29,764,800.00	260,000	14	3.40	39,355.68	-	-
华泰证券	20230217000000982	泰格医药	2023 年 2 月 17 日	5,685,500.00	50,000	14	3.40	7,517.44	-	-
华泰证券	20230220000000783	泰格医药	2023 年 2 月 20 日	4,456,640.00	38,000	14	3.40	5,892.74	-	-
华泰证券	20230302000011723	泰格医药	2023 年 3 月 2 日	29,328,000.00	260,000	14	3.40	38,778.18	-	-
华泰证券	20230316000013404	泰格医药	2023 年 3 月 16 日	27,053,000.00	260,000	14	3.40	35,770.14	-	-
华泰证券	20230330000017417	泰格医药	2023 年 3 月 30 日	26,390,000.00	260,000	14	3.40	34,893.46	-	-
华泰证券	20230413000012255	泰格医药	2023 年 4 月 13 日	27,560,000.00	260,000	14	3.40	36,440.46	-	-
华泰证券	20230427000019924	泰格医药	2023 年 4 月 27 日	23,813,400.00	260,000	14	3.40	31,486.56	-	-
华泰证券	20230511000011359	泰格医药	2023 年 5 月 11 日	23,420,800.00	260,000	14	3.40	30,967.44	-	-
华泰证券	20230525000006728	泰格医药	2023 年 5 月 25 日	22,570,600.00	260,000	14	3.40	29,843.38	-	-
华泰证券	20230607000002499	泰格医药	2023 年 6 月 7 日	3,855,750.00	53,000	14	3.40	5,098.10	-	-
华泰证券	20230608000018320	泰格医药	2023 年 6 月 8 日	19,037,200.00	260,000	14	3.40	32,363.28	-	-
华泰证券	20230530000016222	特变电工	2023 年 5 月 30 日	96,222.00	4,200	14	3.20	119.70	-	-
华泰证券	202306010000	特变电工	2023 年 6 月 1	382,869.00	17,100	14	3.20	476.42	-	-

	01687		日							
华泰证券	20230103000 26129	天合光能	2023年1月3 日	2,656,000.00	40,000	14	3.40	3,511.76	-	-
华泰证券	20230103000 26133	天合光能	2023年1月3 日	2,662,640.00	40,100	14	3.40	3,520.58	-	-
华泰证券	20230104000 00754	天合光能	2023年1月4 日	3,824,380.00	59,000	14	3.40	5,056.66	-	-
华泰证券	20230106000 09122	天合光能	2023年1月6 日	1,599,896.00	22,700	14	3.40	2,115.40	-	-
华泰证券	20230106000 09136	天合光能	2023年1月6 日	1,642,184.00	23,300	14	3.40	2,171.40	-	-
华泰证券	20230117000 32747	天合光能	2023年1月 17日	2,825,600.00	40,000	14	3.40	3,736.04	-	-
华泰证券	20230117000 32749	天合光能	2023年1月 17日	2,832,664.00	40,100	14	3.40	3,745.42	-	-
华泰证券	20230118000 16985	天合光能	2023年1月 18日	4,156,550.00	59,000	14	3.40	5,495.84	-	-
华泰证券	20230120000 07297	天合光能	2023年1月 20日	1,611,700.00	22,700	14	3.40	2,131.08	-	-
华泰证券	20230120000 07303	天合光能	2023年1月 20日	1,654,300.00	23,300	14	3.40	2,187.36	-	-
华泰证券	20230131000 26981	天合光能	2023年1月 31日	2,854,800.00	40,000	14	3.40	3,774.68	-	-
华泰证券	20230131000 32613	天合光能	2023年1月 31日	2,861,937.00	40,100	14	3.40	3,784.06	-	-
华泰证券	20230201000 18110	天合光能	2023年2月1 日	4,092,240.00	59,000	14	3.40	5,410.86	-	-
华泰证券	20230203000 10718	天合光能	2023年2月3 日	1,506,372.00	22,700	14	3.40	1,991.78	-	-
华泰证券	20230203000 10720	天合光能	2023年2月3 日	1,546,188.00	23,300	14	3.40	2,044.42	-	-
华泰证券	20230214000 23933	天合光能	2023年2月 14日	2,601,287.00	40,100	14	3.40	3,439.52	-	-
华泰证券	20230215000 17466	天合光能	2023年2月 15日	3,787,210.00	59,000	14	3.40	5,007.52	-	-
华泰证券	20230217000 19878	天合光能	2023年2月 17日	1,416,480.00	22,700	14	3.40	1,872.92	-	-
华泰证券	20230217000 19880	天合光能	2023年2月 17日	1,453,920.00	23,300	14	3.40	1,922.48	-	-
华泰证券	20230223000 00549	天合光能	2023年2月 23日	315,650.00	5,000	14	3.40	417.34	-	-
华泰证券	20230301000 15879	天合光能	2023年3月1 日	3,575,990.00	59,000	14	3.40	4,728.22	-	-

华泰证券	2023030300010041	天合光能	2023 年 3 月 3 日	1,346,791.00	22,700	14	3.40	1,780.80	-	-
华泰证券	2023030300010043	天合光能	2023 年 3 月 3 日	1,382,389.00	23,300	14	3.40	1,827.84	-	-
华泰证券	2023030900006486	天合光能	2023 年 3 月 9 日	285,250.00	5,000	14	3.40	377.16	-	-
华泰证券	2023031500015633	天合光能	2023 年 3 月 15 日	3,360,640.00	59,000	14	3.40	4,443.46	-	-
华泰证券	2023031700009685	天合光能	2023 年 3 月 17 日	1,239,793.00	23,300	14	3.40	1,639.26	-	-
华泰证券	2023032300006988	天合光能	2023 年 3 月 23 日	259,900.00	5,000	14	3.40	343.70	-	-
华泰证券	2023032900016950	天合光能	2023 年 3 月 29 日	3,013,720.00	59,000	14	3.40	3,984.82	-	-
华泰证券	2023033100008773	天合光能	2023 年 3 月 31 日	1,213,697.00	23,300	14	3.40	1,604.82	-	-
华泰证券	2023040600013754	天合光能	2023 年 4 月 6 日	256,150.00	5,000	14	3.40	338.66	-	-
华泰证券	2023041200031236	天合光能	2023 年 4 月 12 日	2,872,710.00	59,000	14	3.40	3,798.34	-	-
华泰证券	2023041400008159	天合光能	2023 年 4 月 14 日	1,139,370.00	23,300	14	3.40	1,506.54	-	-
华泰证券	2023042000009167	天合光能	2023 年 4 月 20 日	241,450.00	5,000	14	3.40	319.20	-	-
华泰证券	2023042600013788	天合光能	2023 年 4 月 26 日	2,861,500.00	59,000	14	3.40	3,783.50	-	-
华泰证券	2023050400041249	天合光能	2023 年 5 月 4 日	242,300.00	5,000	14	3.40	320.32	-	-
华泰证券	2023051000009436	天合光能	2023 年 5 月 10 日	2,708,690.00	59,000	14	3.40	3,581.48	-	-
华泰证券	2023051800040832	天合光能	2023 年 5 月 18 日	236,750.00	5,000	14	3.40	313.04	-	-
华泰证券	2023052400020304	天合光能	2023 年 5 月 24 日	2,882,150.00	59,000	14	3.40	3,810.80	-	-
华泰证券	2023060100023419	天合光能	2023 年 6 月 1 日	195,000.00	5,000	14	3.40	257.88	-	-
华泰证券	2023060700024671	天合光能	2023 年 6 月 7 日	2,122,820.00	59,000	14	3.40	2,806.86	-	-
华泰证券	2023061500031431	天合光能	2023 年 6 月 15 日	210,550.00	5,000	14	3.40	278.46	-	-
华泰证券	2023062100015612	天合光能	2023 年 6 月 21 日	2,492,750.00	59,000	14	3.40	2,118.87	2,513,990.00	2,118.87
华泰证券	20230629000	天合光能	2023 年 6 月	210,150.00	5,000	14	3.40	19.85	213,050.00	19.85

	41576		29 日							
华泰证券	20230530000 16169	天山股份	2023 年 5 月 30 日	8,410.00	1,000	7	1.80	2.94	-	-
华泰证券	20230529000 01255	天山股份	2023 年 5 月 29 日	205,800.00	24,500	14	1.80	144.06	-	-
华泰证券	20230529000 01372	天山股份	2023 年 5 月 29 日	240,240.00	28,600	14	1.80	168.14	-	-
华泰证券	20230606000 15962	天山股份	2023 年 6 月 6 日	8,120.00	1,000	7	1.80	2.87	-	-
华泰证券	20230606000 02656	天山股份	2023 年 6 月 6 日	243,600.00	30,000	14	3.20	303.10	-	-
华泰证券	20230613000 19557	天山股份	2023 年 6 月 13 日	8,480.00	1,000	7	1.80	2.94	-	-
华泰证券	20230612000 22451	天山股份	2023 年 6 月 12 日	246,532.00	28,600	14	1.80	172.62	-	-
华泰证券	20230613000 02595	天山股份	2023 年 6 月 13 日	265,424.00	31,300	14	3.20	330.26	-	-
华泰证券	20230620000 10242	天山股份	2023 年 6 月 20 日	8,310.00	1,000	7	1.80	2.94	-	-
华泰证券	20230620000 34874	天山股份	2023 年 6 月 20 日	249,300.00	30,000	14	3.20	221.60	244,200.00	221.60
华泰证券	20230627000 20329	天山股份	2023 年 6 月 27 日	8,290.00	1,000	7	1.80	1.23	8,140.00	1.23
华泰证券	20230626000 51207	天山股份	2023 年 6 月 26 日	232,518.00	28,600	14	1.80	46.52	232,804.00	46.52
华泰证券	20230627000 21058	天山股份	2023 年 6 月 27 日	259,477.00	31,300	14	3.20	69.18	254,782.00	69.18
华泰证券	20230518000 01298	通威股份	2023 年 5 月 18 日	383,600.00	10,000	14	3.20	477.40	-	-
华泰证券	20230525000 02814	通威股份	2023 年 5 月 25 日	3,125,600.00	80,000	14	3.20	3,889.62	-	-
华泰证券	20230601000 01693	通威股份	2023 年 6 月 1 日	77,464.00	2,300	14	3.20	96.46	-	-
华泰证券	20230601000 22812	通威股份	2023 年 6 月 1 日	336,800.00	10,000	14	3.20	419.16	-	-
华泰证券	20230607000 02525	通威股份	2023 年 6 月 7 日	9,453,000.00	300,000	14	3.20	11,763.78	-	-
华泰证券	20230607000 02547	通威股份	2023 年 6 月 7 日	6,302,000.00	200,000	14	3.20	7,842.52	-	-
华泰证券	20230608000 22203	通威股份	2023 年 6 月 8 日	2,508,800.00	80,000	14	3.20	4,014.00	-	-
华泰证券	20230615000 32914	通威股份	2023 年 6 月 15 日	76,774.00	2,300	14	3.20	95.48	-	-

华泰证券	20230615000 34780	通威股份	2023 年 6 月 15 日	333,800.00	10,000	14	3.20	415.38	-	-
华泰证券	20230621000 17894	通威股份	2023 年 6 月 21 日	10,278,000.00	300,000	14	3.20	8,222.40	10,293,000.00	8,222.40
华泰证券	20230621000 18152	通威股份	2023 年 6 月 21 日	6,852,000.00	200,000	14	3.20	5,481.63	6,862,000.00	5,481.63
华泰证券	20230626000 36983	通威股份	2023 年 6 月 26 日	2,718,400.00	80,000	14	3.20	966.56	2,744,800.00	966.56
华泰证券	20230629000 29960	通威股份	2023 年 6 月 29 日	78,315.00	2,300	14	3.20	6.96	78,913.00	6.96
华泰证券	20230629000 31780	通威股份	2023 年 6 月 29 日	340,500.00	10,000	14	3.20	30.27	343,100.00	30.27
华泰证券	20230511000 01768	同花顺	2023 年 5 月 11 日	5,074,800.00	30,000	14	3.40	6,710.06	-	-
华泰证券	20230515000 01545	同花顺	2023 年 5 月 15 日	552,224.00	3,200	14	3.40	730.10	-	-
华泰证券	20230517000 01730	同花顺	2023 年 5 月 17 日	4,288,350.00	25,300	14	3.40	5,670.14	-	-
华泰证券	20230522000 01189	同花顺	2023 年 5 月 22 日	5,887,630.00	34,900	14	3.40	7,784.70	-	-
华泰证券	20230529000 11081	同花顺	2023 年 5 月 29 日	494,240.00	3,200	14	3.40	653.52	-	-
华泰证券	20230531000 08924	同花顺	2023 年 5 月 31 日	4,069,252.00	25,300	14	3.40	5,380.48	-	-
华泰证券	20230605000 01026	同花顺	2023 年 6 月 5 日	1,165,560.00	6,600	14	3.40	1,541.12	-	-
华泰证券	20230605000 19339	同花顺	2023 年 6 月 5 日	6,163,340.00	34,900	14	3.40	8,149.26	-	-
华泰证券	20230606000 02648	同花顺	2023 年 6 月 6 日	1,318,278.00	7,800	14	3.40	1,743.00	-	-
华泰证券	20230608000 02326	同花顺	2023 年 6 月 8 日	316,160.00	1,900	14	3.40	537.48	-	-
华泰证券	20230612000 42183	同花顺	2023 年 6 月 12 日	536,512.00	3,200	14	3.40	709.38	-	-
华泰证券	20230613000 02589	同花顺	2023 年 6 月 13 日	2,712,715.00	15,100	14	3.40	3,586.80	-	-
华泰证券	20230614000 51620	同花顺	2023 年 6 月 14 日	4,637,490.00	25,300	14	3.40	6,131.86	-	-
华泰证券	20230619000 19648	同花顺	2023 年 6 月 19 日	7,328,651.00	34,900	14	3.40	7,613.65	6,117,272.00	7,613.65
华泰证券	20230619000 22861	同花顺	2023 年 6 月 19 日	1,385,934.00	6,600	14	3.40	1,439.79	1,156,848.00	1,439.79
华泰证券	20230626000	同花顺	2023 年 6 月	2,647,700.00	14,500	14	3.40	1,000.24	2,541,560.	1,000.24

	01431		26 日						00	
华泰证券	20230626000 32644	同花顺	2023 年 6 月 26 日	584,320.00	3,200	14	3.40	220.76	560,896.00	220.76
华泰证券	20230627000 21725	同花顺	2023 年 6 月 27 日	2,787,913.00	15,100	14	3.40	789.90	2,646,728.00	789.90
华泰证券	20230628000 42180	同花顺	2023 年 6 月 28 日	4,518,580.00	25,300	14	3.40	853.52	4,434,584.00	853.52
华泰证券	20230606000 02603	万泰生物	2023 年 6 月 6 日	1,244,000.00	20,000	14	3.20	1,548.12	-	-
华泰证券	20230620000 31407	万泰生物	2023 年 6 月 20 日	1,349,600.00	20,000	14	3.20	1,199.60	1,335,400.00	1,199.60
华泰证券	20230223000 00583	温氏股份	2023 年 2 月 23 日	100,300.00	5,000	14	3.40	132.58	-	-
华泰证券	20230309000 06534	温氏股份	2023 年 3 月 9 日	91,200.00	5,000	14	3.40	120.54	-	-
华泰证券	20230323000 07022	温氏股份	2023 年 3 月 23 日	96,700.00	5,000	14	3.40	127.82	-	-
华泰证券	20230406000 13000	温氏股份	2023 年 4 月 6 日	109,400.00	5,000	14	3.40	144.62	-	-
华泰证券	20230420000 05439	温氏股份	2023 年 4 月 20 日	106,050.00	5,000	14	3.40	140.28	-	-
华泰证券	20230504000 37301	温氏股份	2023 年 5 月 4 日	97,450.00	5,000	14	3.40	128.80	-	-
华泰证券	20230518000 40378	温氏股份	2023 年 5 月 18 日	91,750.00	5,000	14	3.40	121.38	-	-
华泰证券	20230601000 28811	温氏股份	2023 年 6 月 1 日	83,350.00	5,000	14	3.40	110.18	-	-
华泰证券	20230615000 30694	温氏股份	2023 年 6 月 15 日	84,050.00	5,000	14	3.40	111.16	-	-
华泰证券	20230629000 42047	温氏股份	2023 年 6 月 29 日	90,600.00	5,000	14	3.40	8.56	91,750.00	8.56
华泰证券	20230417000 01909	闻泰科技	2023 年 4 月 17 日	3,213,500.00	50,000	14	3.20	4,855.88	-	-
华泰证券	20230504000 21491	闻泰科技	2023 年 5 月 4 日	2,669,500.00	50,000	14	3.20	3,322.06	-	-
华泰证券	20230518000 40016	闻泰科技	2023 年 5 月 18 日	2,678,500.00	50,000	14	3.20	3,333.26	-	-
华泰证券	20230601000 22048	闻泰科技	2023 年 6 月 1 日	2,569,500.00	50,000	14	3.20	3,197.60	-	-
华泰证券	20230615000 38318	闻泰科技	2023 年 6 月 15 日	2,546,000.00	50,000	14	3.20	3,168.34	-	-
华泰证券	20230629000 41696	闻泰科技	2023 年 6 月 29 日	2,425,500.00	50,000	14	3.20	215.60	2,445,000.00	215.60

华泰证券	2023022300000562	沃森生物	2023 年 2 月 23 日	192,400.00	5,000	14	3.40	254.38	-	-
华泰证券	2023030900006508	沃森生物	2023 年 3 月 9 日	195,700.00	5,000	14	3.40	258.72	-	-
华泰证券	2023032300007004	沃森生物	2023 年 3 月 23 日	183,050.00	5,000	14	3.40	242.06	-	-
华泰证券	20230406000013014	沃森生物	2023 年 4 月 6 日	174,600.00	5,000	14	3.40	230.86	-	-
华泰证券	20230420000012619	沃森生物	2023 年 4 月 20 日	166,950.00	5,000	14	3.40	220.78	-	-
华泰证券	20230504000031651	沃森生物	2023 年 5 月 4 日	157,450.00	5,000	14	3.40	208.18	-	-
华泰证券	20230517000001735	沃森生物	2023 年 5 月 17 日	1,310,210.00	43,000	14	3.40	1,732.36	-	-
华泰证券	20230518000040792	沃森生物	2023 年 5 月 18 日	148,300.00	5,000	14	3.40	196.14	-	-
华泰证券	20230601000001700	沃森生物	2023 年 6 月 1 日	1,439,500.00	50,000	14	3.40	1,903.30	-	-
华泰证券	20230601000022252	沃森生物	2023 年 6 月 1 日	143,950.00	5,000	14	3.40	190.40	-	-
华泰证券	20230615000029363	沃森生物	2023 年 6 月 15 日	135,100.00	5,000	14	3.40	178.64	-	-
华泰证券	20230629000044003	沃森生物	2023 年 6 月 29 日	130,050.00	5,000	14	3.40	12.28	132,250.00	12.28
华泰证券	20230616000002189	五 粮 液	2023 年 6 月 16 日	2,779,608.00	15,100	14	3.20	3,459.12	-	-
华泰证券	20230630000016614	五 粮 液	2023 年 6 月 30 日	2,469,907.00	15,100	14	3.20	-	2,469,907.00	-
华泰证券	20230103000026275	先导智能	2023 年 1 月 3 日	2,794,764.00	67,900	14	3.40	3,695.30	-	-
华泰证券	20230106000009138	先导智能	2023 年 1 月 6 日	80,120.00	2,000	14	3.40	105.98	-	-
华泰证券	20230110000016743	先导智能	2023 年 1 月 10 日	172,080.00	4,000	14	3.40	325.00	-	-
华泰证券	20230117000023843	先导智能	2023 年 1 月 17 日	2,979,452.00	67,900	14	3.40	3,939.46	-	-
华泰证券	20230120000007305	先导智能	2023 年 1 月 20 日	89,240.00	2,000	14	3.40	118.02	-	-
华泰证券	20230130000091871	先导智能	2023 年 1 月 30 日	185,640.00	4,000	14	3.40	245.42	-	-
华泰证券	20230131000027017	先导智能	2023 年 1 月 31 日	3,132,227.00	67,900	14	3.40	4,141.48	-	-
华泰证券	202302030000	先导智能	2023 年 2 月 3 日	95,400.00	2,000	14	3.40	126.14	-	-

	10722		日							
华泰证券	20230213000 79448	先导智能	2023 年 2 月 13 日	184,920.00	4,000	14	3.40	244.58	-	-
华泰证券	20230214000 24601	先导智能	2023 年 2 月 14 日	3,124,758.00	67,900	14	3.40	4,131.68	-	-
华泰证券	20230217000 18202	先导智能	2023 年 2 月 17 日	90,160.00	2,000	14	3.40	119.28	-	-
华泰证券	20230227000 70460	先导智能	2023 年 2 月 27 日	173,240.00	4,000	14	3.40	229.04	-	-
华泰证券	20230228000 26468	先导智能	2023 年 2 月 28 日	2,953,650.00	67,900	14	3.40	3,905.44	-	-
华泰证券	20230303000 11635	先导智能	2023 年 3 月 3 日	86,000.00	2,000	14	3.40	113.68	-	-
华泰证券	20230313000 69682	先导智能	2023 年 3 月 13 日	163,360.00	4,000	14	3.40	216.02	-	-
华泰证券	20230314000 19694	先导智能	2023 年 3 月 14 日	2,780,505.00	67,900	14	3.40	3,676.40	-	-
华泰证券	20230317000 09711	先导智能	2023 年 3 月 17 日	77,500.00	2,000	14	3.40	102.48	-	-
华泰证券	20230327000 68123	先导智能	2023 年 3 月 27 日	158,680.00	4,000	14	3.40	209.86	-	-
华泰证券	20230328000 26613	先导智能	2023 年 3 月 28 日	2,654,890.00	67,900	14	3.40	3,510.36	-	-
华泰证券	20230410000 61793	先导智能	2023 年 4 月 10 日	157,640.00	4,000	14	3.40	208.46	-	-
华泰证券	20230411000 17708	先导智能	2023 年 4 月 11 日	2,632,483.00	67,900	14	3.40	3,480.68	-	-
华泰证券	20230424000 51595	先导智能	2023 年 4 月 24 日	143,680.00	4,000	14	3.40	189.98	-	-
华泰证券	20230425000 62029	先导智能	2023 年 4 月 25 日	2,341,192.00	67,900	14	3.40	3,095.54	-	-
华泰证券	20230508000 62589	先导智能	2023 年 5 月 8 日	149,400.00	4,000	14	3.40	197.54	-	-
华泰证券	20230103000 26211	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	158,775.00	7,300	14	3.40	210.00	-	-
华泰证券	20230103000 39315	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	261,000.00	12,000	14	3.40	345.10	-	-
华泰证券	20230103000 39333	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	282,750.00	13,000	14	3.40	373.80	-	-
华泰证券	20230103000 39335	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	174,000.00	8,000	14	3.40	230.02	-	-
华泰证券	20230103000 39337	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	348,000.00	16,000	14	3.40	460.18	-	-

华泰证券	20230103000 39347	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	261,000.00	12,000	14	3.40	345.10	-	-
华泰证券	20230103000 40199	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	239,250.00	11,000	14	3.40	316.40	-	-
华泰证券	20230103000 40201	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	130,500.00	6,000	14	3.40	172.62	-	-
华泰证券	20230103000 40203	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	593,775.00	27,300	14	3.40	785.12	-	-
华泰证券	20230103000 40205	欣旺达	2023 年 1 月 3 日	43,500.00	2,000	14	3.40	57.54	-	-
华泰证券	20230104000 15060	欣旺达	2023 年 1 月 4 日	417,600.00	20,000	14	3.40	552.16	-	-
华泰证券	20230104000 15062	欣旺达	2023 年 1 月 4 日	125,280.00	6,000	14	3.40	165.62	-	-
华泰证券	20230104000 15064	欣旺达	2023 年 1 月 4 日	83,520.00	4,000	14	3.40	110.46	-	-
华泰证券	20230104000 15066	欣旺达	2023 年 1 月 4 日	208,800.00	10,000	14	3.40	276.08	-	-
华泰证券	20230105000 17549	欣旺达	2023 年 1 月 5 日	193,860.00	9,000	14	3.40	256.34	-	-
华泰证券	20230105000 17551	欣旺达	2023 年 1 月 5 日	86,160.00	4,000	14	3.40	113.96	-	-
华泰证券	20230105000 17553	欣旺达	2023 年 1 月 5 日	43,080.00	2,000	14	3.40	56.98	-	-
华泰证券	20230105000 17555	欣旺达	2023 年 1 月 5 日	224,016.00	10,400	14	3.40	296.24	-	-
华泰证券	20230106000 09124	欣旺达	2023 年 1 月 6 日	303,940.00	14,000	14	3.40	401.94	-	-
华泰证券	20230106000 09126	欣旺达	2023 年 1 月 6 日	21,710.00	1,000	14	3.40	28.70	-	-
华泰证券	20230109000 37516	欣旺达	2023 年 1 月 9 日	1,687,070.00	77,000	14	3.40	3,345.93	-	-
华泰证券	20230110000 17253	欣旺达	2023 年 1 月 10 日	181,520.00	8,000	14	3.40	342.80	-	-
华泰证券	20230112000 12935	欣旺达	2023 年 1 月 12 日	22,150.00	1,000	14	3.40	37.62	-	-
华泰证券	20230112000 15789	欣旺达	2023 年 1 月 12 日	1,107,500.00	50,000	14	3.40	1,882.80	-	-
华泰证券	20230112000 15791	欣旺达	2023 年 1 月 12 日	553,750.00	25,000	14	3.40	941.40	-	-
华泰证券	20230113000 09826	欣旺达	2023 年 1 月 13 日	67,800.00	3,000	14	3.40	108.80	-	-
华泰证券	20230117000	欣旺达	2023 年 1 月	292,500.00	13,000	14	3.40	386.82	-	-

	22215		17 日							
华泰证券	20230117000 22217	欣旺达	2023 年 1 月 17 日	270,000.00	12,000	14	3.40	357.00	-	-
华泰证券	20230117000 22219	欣旺达	2023 年 1 月 17 日	164,250.00	7,300	14	3.40	217.14	-	-
华泰证券	20230117000 22223	欣旺达	2023 年 1 月 17 日	270,000.00	12,000	14	3.40	357.00	-	-
华泰证券	20230117000 22229	欣旺达	2023 年 1 月 17 日	180,000.00	8,000	14	3.40	238.00	-	-
华泰证券	20230117000 22231	欣旺达	2023 年 1 月 17 日	360,000.00	16,000	14	3.40	476.00	-	-
华泰证券	20230117000 23847	欣旺达	2023 年 1 月 17 日	247,500.00	11,000	14	3.40	327.32	-	-
华泰证券	20230117000 23849	欣旺达	2023 年 1 月 17 日	135,000.00	6,000	14	3.40	178.50	-	-
华泰证券	20230117000 23851	欣旺达	2023 年 1 月 17 日	614,250.00	27,300	14	3.40	812.14	-	-
华泰证券	20230117000 23853	欣旺达	2023 年 1 月 17 日	45,000.00	2,000	14	3.40	59.50	-	-
华泰证券	20230118000 17035	欣旺达	2023 年 1 月 18 日	450,800.00	20,000	14	3.40	596.12	-	-
华泰证券	20230118000 17037	欣旺达	2023 年 1 月 18 日	135,240.00	6,000	14	3.40	178.78	-	-
华泰证券	20230118000 17039	欣旺达	2023 年 1 月 18 日	90,160.00	4,000	14	3.40	119.28	-	-
华泰证券	20230118000 17041	欣旺达	2023 年 1 月 18 日	225,400.00	10,000	14	3.40	298.06	-	-
华泰证券	20230119000 13126	欣旺达	2023 年 1 月 19 日	203,580.00	9,000	14	3.40	269.22	-	-
华泰证券	20230119000 13128	欣旺达	2023 年 1 月 19 日	90,480.00	4,000	14	3.40	119.70	-	-
华泰证券	20230119000 13130	欣旺达	2023 年 1 月 19 日	45,240.00	2,000	14	3.40	59.78	-	-
华泰证券	20230119000 13132	欣旺达	2023 年 1 月 19 日	235,248.00	10,400	14	3.40	311.08	-	-
华泰证券	20230120000 07299	欣旺达	2023 年 1 月 20 日	320,600.00	14,000	14	3.40	423.92	-	-
华泰证券	20230120000 07301	欣旺达	2023 年 1 月 20 日	22,900.00	1,000	14	3.40	30.24	-	-
华泰证券	20230130000 80823	欣旺达	2023 年 1 月 30 日	1,801,800.00	77,000	14	3.40	2,382.38	-	-
华泰证券	20230130000 80845	欣旺达	2023 年 1 月 30 日	23,400.00	1,000	14	3.40	30.94	-	-

华泰证券	20230130000 82255	欣旺达	2023 年 1 月 30 日	70,200.00	3,000	14	3.40	92.82	-	-
华泰证券	20230130000 85439	欣旺达	2023 年 1 月 30 日	585,000.00	25,000	14	3.40	773.50	-	-
华泰证券	20230130000 94393	欣旺达	2023 年 1 月 30 日	187,200.00	8,000	14	3.40	247.52	-	-
华泰证券	20230130000 94493	欣旺达	2023 年 1 月 30 日	1,170,000.00	50,000	14	3.40	1,547.00	-	-
华泰证券	20230131000 32659	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	305,500.00	13,000	14	3.40	403.90	-	-
华泰证券	20230131000 32661	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	282,000.00	12,000	14	3.40	372.82	-	-
华泰证券	20230131000 32663	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	641,550.00	27,300	14	3.40	848.26	-	-
华泰证券	20230131000 32665	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	47,000.00	2,000	14	3.40	62.16	-	-
华泰证券	20230131000 32667	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	258,500.00	11,000	14	3.40	341.74	-	-
华泰证券	20230131000 32669	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	141,000.00	6,000	14	3.40	186.48	-	-
华泰证券	20230131000 32673	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	282,000.00	12,000	14	3.40	372.82	-	-
华泰证券	20230131000 32675	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	188,000.00	8,000	14	3.40	248.64	-	-
华泰证券	20230131000 32677	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	376,000.00	16,000	14	3.40	497.14	-	-
华泰证券	20230131000 32685	欣旺达	2023 年 1 月 31 日	171,550.00	7,300	14	3.40	226.80	-	-
华泰证券	20230201000 19524	欣旺达	2023 年 2 月 1 日	95,400.00	4,000	14	3.40	126.14	-	-
华泰证券	20230201000 19526	欣旺达	2023 年 2 月 1 日	238,500.00	10,000	14	3.40	315.42	-	-
华泰证券	20230201000 19528	欣旺达	2023 年 2 月 1 日	477,000.00	20,000	14	3.40	630.70	-	-
华泰证券	20230201000 19530	欣旺达	2023 年 2 月 1 日	143,100.00	6,000	14	3.40	189.28	-	-
华泰证券	20230202000 14455	欣旺达	2023 年 2 月 2 日	212,130.00	9,000	14	3.40	280.42	-	-
华泰证券	20230202000 14457	欣旺达	2023 年 2 月 2 日	94,280.00	4,000	14	3.40	124.60	-	-
华泰证券	20230202000 14459	欣旺达	2023 年 2 月 2 日	47,140.00	2,000	14	3.40	62.30	-	-
华泰证券	20230202000	欣旺达	2023 年 2 月 2	245,128.00	10,400	14	3.40	324.10	-	-

	14461		日							
华泰证券	20230203000 11184	欣旺达	2023 年 2 月 3 日	326,200.00	14,000	14	3.40	431.34	-	-
华泰证券	20230203000 11186	欣旺达	2023 年 2 月 3 日	23,300.00	1,000	14	3.40	30.80	-	-
华泰证券	20230206000 00894	欣旺达	2023 年 2 月 6 日	6,182,450.00	265,000	14	3.20	7,693.70	-	-
华泰证券	20230213000 78044	欣旺达	2023 年 2 月 13 日	70,050.00	3,000	14	3.40	92.68	-	-
华泰证券	20230213000 78114	欣旺达	2023 年 2 月 13 日	1,167,500.00	50,000	14	3.40	1,543.64	-	-
华泰证券	20230213000 79358	欣旺达	2023 年 2 月 13 日	23,350.00	1,000	14	3.40	30.94	-	-
华泰证券	20230213000 79376	欣旺达	2023 年 2 月 13 日	186,800.00	8,000	14	3.40	246.96	-	-
华泰证券	20230213000 79434	欣旺达	2023 年 2 月 13 日	1,797,950.00	77,000	14	3.40	2,377.34	-	-
华泰证券	20230213000 82958	欣旺达	2023 年 2 月 13 日	583,750.00	25,000	14	3.40	771.82	-	-
华泰证券	20230214000 23883	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	370,400.00	16,000	14	3.40	489.72	-	-
华泰证券	20230214000 23885	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	168,995.00	7,300	14	3.40	223.44	-	-
华泰证券	20230214000 23889	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	277,800.00	12,000	14	3.40	367.36	-	-
华泰证券	20230214000 23891	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	185,200.00	8,000	14	3.40	244.86	-	-
华泰证券	20230214000 23893	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	254,650.00	11,000	14	3.40	336.70	-	-
华泰证券	20230214000 23895	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	138,900.00	6,000	14	3.40	183.68	-	-
华泰证券	20230214000 23897	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	300,950.00	13,000	14	3.40	397.88	-	-
华泰证券	20230214000 23899	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	277,800.00	12,000	14	3.40	367.36	-	-
华泰证券	20230214000 23901	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	631,995.00	27,300	14	3.40	835.66	-	-
华泰证券	20230214000 23903	欣旺达	2023 年 2 月 14 日	46,300.00	2,000	14	3.40	61.18	-	-
华泰证券	20230215000 15372	欣旺达	2023 年 2 月 15 日	466,400.00	20,000	14	3.40	616.70	-	-
华泰证券	20230215000 15374	欣旺达	2023 年 2 月 15 日	139,920.00	6,000	14	3.40	185.08	-	-

华泰证券	20230215000 15376	欣旺达	2023 年 2 月 15 日	93,280.00	4,000	14	3.40	123.34	-	-
华泰证券	20230215000 15378	欣旺达	2023 年 2 月 15 日	233,200.00	10,000	14	3.40	308.28	-	-
华泰证券	20230216000 13685	欣旺达	2023 年 2 月 16 日	202,500.00	9,000	14	3.40	267.82	-	-
华泰证券	20230216000 13687	欣旺达	2023 年 2 月 16 日	90,000.00	4,000	14	3.40	119.00	-	-
华泰证券	20230216000 13689	欣旺达	2023 年 2 月 16 日	45,000.00	2,000	14	3.40	59.50	-	-
华泰证券	20230216000 13691	欣旺达	2023 年 2 月 16 日	234,000.00	10,400	14	3.40	309.40	-	-
华泰证券	20230217000 18212	欣旺达	2023 年 2 月 17 日	308,700.00	14,000	14	3.40	408.24	-	-
华泰证券	20230217000 18214	欣旺达	2023 年 2 月 17 日	22,050.00	1,000	14	3.40	29.12	-	-
华泰证券	20230220000 08332	欣旺达	2023 年 2 月 20 日	5,763,750.00	265,000	14	3.20	7,172.62	-	-
华泰证券	20230227000 62248	欣旺达	2023 年 2 月 27 日	171,120.00	8,000	14	3.40	226.24	-	-
华泰证券	20230227000 64196	欣旺达	2023 年 2 月 27 日	64,170.00	3,000	14	3.40	84.84	-	-
华泰证券	20230227000 64210	欣旺达	2023 年 2 月 27 日	1,647,030.00	77,000	14	3.40	2,177.70	-	-
华泰证券	20230227000 66144	欣旺达	2023 年 2 月 27 日	534,750.00	25,000	14	3.40	707.00	-	-
华泰证券	20230227000 77320	欣旺达	2023 年 2 月 27 日	1,069,500.00	50,000	14	3.40	1,414.14	-	-
华泰证券	20230227000 77368	欣旺达	2023 年 2 月 27 日	21,390.00	1,000	14	3.40	28.28	-	-
华泰证券	20230228000 21422	欣旺达	2023 年 2 月 28 日	259,440.00	12,000	14	3.40	343.00	-	-
华泰证券	20230228000 21530	欣旺达	2023 年 2 月 28 日	157,826.00	7,300	14	3.40	208.74	-	-
华泰证券	20230228000 23924	欣旺达	2023 年 2 月 28 日	281,060.00	13,000	14	3.40	371.56	-	-
华泰证券	20230228000 23926	欣旺达	2023 年 2 月 28 日	590,226.00	27,300	14	3.40	780.36	-	-
华泰证券	20230228000 23928	欣旺达	2023 年 2 月 28 日	43,240.00	2,000	14	3.40	57.12	-	-
华泰证券	20230228000 24042	欣旺达	2023 年 2 月 28 日	237,820.00	11,000	14	3.40	314.44	-	-
华泰证券	20230228000	欣旺达	2023 年 2 月	129,720.00	6,000	14	3.40	171.50	-	-

	24044		28 日							
华泰证券	20230228000 24046	欣旺达	2023 年 2 月 28 日	345,920.00	16,000	14	3.40	457.38	-	-
华泰证券	20230228000 24048	欣旺达	2023 年 2 月 28 日	259,440.00	12,000	14	3.40	343.00	-	-
华泰证券	20230228000 24050	欣旺达	2023 年 2 月 28 日	172,960.00	8,000	14	3.40	228.76	-	-
华泰证券	20230301000 01140	欣旺达	2023 年 3 月 1 日	226,304.00	10,400	14	3.40	299.18	-	-
华泰证券	20230301000 15901	欣旺达	2023 年 3 月 1 日	435,200.00	20,000	14	3.40	575.40	-	-
华泰证券	20230301000 15903	欣旺达	2023 年 3 月 1 日	87,040.00	4,000	14	3.40	115.08	-	-
华泰证券	20230301000 15905	欣旺达	2023 年 3 月 1 日	217,600.00	10,000	14	3.40	287.70	-	-
华泰证券	20230301000 19561	欣旺达	2023 年 3 月 1 日	130,560.00	6,000	14	3.40	172.62	-	-
华泰证券	20230302000 11809	欣旺达	2023 年 3 月 2 日	195,570.00	9,000	14	3.40	258.58	-	-
华泰证券	20230302000 11811	欣旺达	2023 年 3 月 2 日	86,920.00	4,000	14	3.40	114.94	-	-
华泰证券	20230302000 11813	欣旺达	2023 年 3 月 2 日	43,460.00	2,000	14	3.40	57.40	-	-
华泰证券	20230303000 10091	欣旺达	2023 年 3 月 3 日	302,260.00	14,000	14	3.40	399.70	-	-
华泰证券	20230303000 10093	欣旺达	2023 年 3 月 3 日	21,590.00	1,000	14	3.40	28.56	-	-
华泰证券	20230306000 17013	欣旺达	2023 年 3 月 6 日	5,692,200.00	265,000	14	3.20	7,083.58	-	-
华泰证券	20230320000 08882	欣旺达	2023 年 3 月 20 日	5,090,650.00	265,000	14	3.20	452.50	-	-
华泰证券	20230321000 04619	欣旺达	2023 年 3 月 20 日	5,090,650.00	265,000	2	3.20	452.50	-	-
华泰证券	20230313000 63020	欣旺达	2023 年 3 月 13 日	162,960.00	8,000	14	3.40	215.46	-	-
华泰证券	20230313000 63064	欣旺达	2023 年 3 月 13 日	61,110.00	3,000	14	3.40	80.78	-	-
华泰证券	20230313000 64824	欣旺达	2023 年 3 月 13 日	1,018,500.00	50,000	14	3.40	1,346.66	-	-
华泰证券	20230313000 64884	欣旺达	2023 年 3 月 13 日	1,568,490.00	77,000	14	3.40	2,073.96	-	-
华泰证券	20230313000 68966	欣旺达	2023 年 3 月 13 日	509,250.00	25,000	14	3.40	673.40	-	-

华泰证券	20230313000 70278	欣旺达	2023 年 3 月 13 日	20,370.00	1,000	14	3.40	26.88	-	-
华泰证券	20230314000 19552	欣旺达	2023 年 3 月 14 日	221,650.00	11,000	14	3.40	293.02	-	-
华泰证券	20230314000 19554	欣旺达	2023 年 3 月 14 日	322,400.00	16,000	14	3.40	426.30	-	-
华泰证券	20230314000 19556	欣旺达	2023 年 3 月 14 日	550,095.00	27,300	14	3.40	727.30	-	-
华泰证券	20230314000 19558	欣旺达	2023 年 3 月 14 日	40,300.00	2,000	14	3.40	53.34	-	-
华泰证券	20230314000 19560	欣旺达	2023 年 3 月 14 日	241,800.00	12,000	14	3.40	319.76	-	-
华泰证券	20230315000 01239	欣旺达	2023 年 3 月 15 日	933,408.00	46,300	14	3.40	1,234.24	-	-
华泰证券	20230315000 20257	欣旺达	2023 年 3 月 15 日	209,664.00	10,400	14	3.40	277.20	-	-
华泰证券	20230315000 20273	欣旺达	2023 年 3 月 15 日	403,200.00	20,000	14	3.40	533.12	-	-
华泰证券	20230315000 20275	欣旺达	2023 年 3 月 15 日	80,640.00	4,000	14	3.40	106.68	-	-
华泰证券	20230315000 20277	欣旺达	2023 年 3 月 15 日	201,600.00	10,000	14	3.40	266.56	-	-
华泰证券	20230316000 13338	欣旺达	2023 年 3 月 16 日	76,520.00	4,000	14	3.40	101.22	-	-
华泰证券	20230316000 13340	欣旺达	2023 年 3 月 16 日	38,260.00	2,000	14	3.40	50.54	-	-
华泰证券	20230317000 09691	欣旺达	2023 年 3 月 17 日	18,810.00	1,000	14	3.40	24.92	-	-
华泰证券	20230327000 68049	欣旺达	2023 年 3 月 27 日	61,140.00	3,000	14	3.40	80.78	-	-
华泰证券	20230327000 68057	欣旺达	2023 年 3 月 27 日	1,019,000.00	50,000	14	3.40	1,347.36	-	-
华泰证券	20230327000 68847	欣旺达	2023 年 3 月 27 日	1,569,260.00	77,000	14	3.40	2,074.94	-	-
华泰证券	20230327000 69539	欣旺达	2023 年 3 月 27 日	509,500.00	25,000	14	3.40	673.68	-	-
华泰证券	20230327000 69591	欣旺达	2023 年 3 月 27 日	163,040.00	8,000	14	3.40	215.60	-	-
华泰证券	20230327000 73581	欣旺达	2023 年 3 月 27 日	20,380.00	1,000	14	3.40	27.02	-	-
华泰证券	20230328000 25671	欣旺达	2023 年 3 月 28 日	221,540.00	11,000	14	3.40	292.88	-	-
华泰证券	20230328000	欣旺达	2023 年 3 月	40,280.00	2,000	14	3.40	53.20	-	-

	25673		28 日							
华泰证券	20230328000 25675	欣旺达	2023 年 3 月 28 日	241,680.00	12,000	14	3.40	319.62	-	-
华泰证券	20230329000 16824	欣旺达	2023 年 3 月 29 日	402,000.00	20,000	14	3.40	531.58	-	-
华泰证券	20230329000 16826	欣旺达	2023 年 3 月 29 日	201,000.00	10,000	14	3.40	265.72	-	-
华泰证券	20230329000 16974	欣旺达	2023 年 3 月 29 日	209,040.00	10,400	14	3.40	276.36	-	-
华泰证券	20230330000 17393	欣旺达	2023 年 3 月 30 日	80,320.00	4,000	14	3.40	106.26	-	-
华泰证券	20230330000 17395	欣旺达	2023 年 3 月 30 日	40,160.00	2,000	14	3.40	53.06	-	-
华泰证券	20230630000 01478	欣旺达	2023 年 6 月 30 日	212,160.00	13,000	14	3.40	- 212,160.00	-	-
华泰证券	20230524000 01865	新 和 成	2023 年 5 月 24 日	44,577.00	2,700	14	3.40	58.94	-	-
华泰证券	20230619000 20749	新 和 成	2023 年 6 月 19 日	103,649.00	6,700	14	3.20	101.31	103,180.00	101.31
华泰证券	20230525000 02816	新 希 望	2023 年 5 月 25 日	26,795.00	2,300	14	3.20	33.32	-	-
华泰证券	20230606000 02662	新 希 望	2023 年 6 月 6 日	35,557.00	3,100	14	3.20	44.24	-	-
华泰证券	20230608000 19985	新 希 望	2023 年 6 月 8 日	27,347.00	2,300	14	3.20	43.74	-	-
华泰证券	20230620000 31949	新 希 望	2023 年 6 月 20 日	36,828.00	3,100	14	3.20	32.70	36,208.00	32.70
华泰证券	20230626000 35912	新 希 望	2023 年 6 月 26 日	26,887.00	2,300	14	3.20	9.56	26,864.00	9.56
华泰证券	20230602000 01111	新奥股份	2023 年 6 月 2 日	19,270.00	1,000	14	3.20	23.94	-	-
华泰证券	20230616000 19708	新奥股份	2023 年 6 月 16 日	18,490.00	1,000	14	3.20	22.96	-	-
华泰证券	20230619000 01072	新奥股份	2023 年 6 月 19 日	18,880.00	1,000	14	3.20	18.48	18,980.00	18.48
华泰证券	20230630000 21708	新奥股份	2023 年 6 月 30 日	18,980.00	1,000	14	3.20	- 18,980.00	-	-
华泰证券	20230605000 01089	新和成	2023 年 6 月 5 日	104,453.00	6,700	14	3.20	130.06	-	-
华泰证券	20230607000 16829	新和成	2023 年 6 月 7 日	41,607.00	2,700	14	3.40	55.02	-	-
华泰证券	20230621000 13663	新和成	2023 年 6 月 21 日	40,905.00	2,700	14	3.40	34.74	41,580.00	34.74

华泰证券	20230530000 16187	新华保险	2023 年 5 月 30 日	404,717.00	10,900	7	1.80	141.68	-	-
华泰证券	20230529000 01362	新华保险	2023 年 5 月 29 日	257,040.00	7,000	14	1.80	179.90	-	-
华泰证券	20230529000 01363	新华保险	2023 年 5 月 29 日	2,037,960.00	55,500	14	1.80	1,426.60	-	-
华泰证券	20230606000 16395	新华保险	2023 年 6 月 6 日	406,461.00	10,900	7	1.80	142.24	-	-
华泰证券	20230613000 20083	新华保险	2023 年 6 月 13 日	423,029.00	10,900	7	1.80	148.05	-	-
华泰证券	20230612000 23050	新华保险	2023 年 6 月 12 日	2,145,630.00	55,500	14	1.80	1,501.92	-	-
华泰证券	20230613000 02637	新华保险	2023 年 6 月 13 日	97,025.00	2,500	14	3.20	120.68	-	-
华泰证券	20230620000 10280	新华保险	2023 年 6 月 20 日	400,357.00	10,900	7	1.80	140.14	-	-
华泰证券	20230614000 16398	新华保险	2023 年 6 月 14 日	77,080.00	2,000	14	3.20	95.90	-	-
华泰证券	20230615000 03692	新华保险	2023 年 6 月 15 日	41,998.00	1,100	14	3.20	52.22	-	-
华泰证券	20230627000 21805	新华保险	2023 年 6 月 27 日	391,528.00	10,900	7	1.80	58.74	400,793.00	58.74
华泰证券	20230626000 37047	新华保险	2023 年 6 月 26 日	1,953,600.00	55,500	14	1.80	390.72	2,040,735.00	390.72
华泰证券	20230628000 37880	新华保险	2023 年 6 月 28 日	72,240.00	2,000	14	3.20	12.84	73,540.00	12.84
华泰证券	20230629000 43752	新华保险	2023 年 6 月 29 日	40,018.00	1,100	14	3.20	3.56	40,447.00	3.56
华泰证券	20230606000 02668	星宇股份	2023 年 6 月 6 日	539,098.00	4,900	14	3.20	670.88	-	-
华泰证券	20230620000 33660	星宇股份	2023 年 6 月 20 日	577,710.00	4,900	14	3.20	513.50	605,640.00	513.50
华泰证券	20230515000 01543	兖矿能源	2023 年 5 月 15 日	35,490.00	1,000	14	3.20	44.24	-	-
华泰证券	20230529000 01455	兖矿能源	2023 年 5 月 29 日	2,802,880.00	92,200	14	3.20	3,488.10	-	-
华泰证券	20230529000 11085	兖矿能源	2023 年 5 月 29 日	30,400.00	1,000	14	3.20	37.80	-	-
华泰证券	20230605000 01044	兖矿能源	2023 年 6 月 5 日	50,166.00	1,800	14	3.20	62.44	-	-
华泰证券	20230612000 40460	兖矿能源	2023 年 6 月 12 日	2,625,856.00	92,200	14	3.20	3,267.74	-	-
华泰证券	20230612000	兖矿能源	2023 年 6 月	28,480.00	1,000	14	3.20	35.42	-	-

	41211		12 日							
华泰证券	20230619000 19680	兖矿能源	2023 年 6 月 19 日	51,822.00	1,800	14	3.20	50.71	53,856.00	50.71
华泰证券	20230626000 31395	兖矿能源	2023 年 6 月 26 日	2,609,260.00	92,200	14	3.20	927.72	2,758,624.00	927.72
华泰证券	20230626000 32192	兖矿能源	2023 年 6 月 26 日	28,300.00	1,000	14	3.20	10.08	29,920.00	10.08
华泰证券	20230103000 28127	阳光电源	2023 年 1 月 3 日	6,069,525.00	52,500	14	3.40	8,025.22	-	-
华泰证券	20230113000 09764	阳光电源	2023 年 1 月 13 日	11,803,392.00	98,100	14	3.40	18,951.09	-	-
华泰证券	20230117000 22123	阳光电源	2023 年 1 月 17 日	6,389,250.00	52,500	14	3.40	8,448.02	-	-
华泰证券	20230130000 82257	阳光电源	2023 年 1 月 30 日	12,841,290.00	98,100	14	3.40	16,979.06	-	-
华泰证券	20230131000 33133	阳光电源	2023 年 1 月 31 日	6,825,000.00	52,500	14	3.40	9,024.12	-	-
华泰证券	20230214000 24599	阳光电源	2023 年 2 月 14 日	6,272,700.00	52,500	14	3.40	8,293.88	-	-
华泰证券	20230228000 26478	阳光电源	2023 年 2 月 28 日	6,279,000.00	52,500	14	3.40	8,302.28	-	-
华泰证券	20230314000 19568	阳光电源	2023 年 3 月 14 日	5,550,300.00	52,500	14	3.40	7,338.80	-	-
华泰证券	20230328000 26653	阳光电源	2023 年 3 月 28 日	5,458,425.00	52,500	14	3.40	7,217.28	-	-
华泰证券	20230411000 20466	阳光电源	2023 年 4 月 11 日	5,398,050.00	52,500	14	3.40	7,137.48	-	-
华泰证券	20230425000 55171	阳光电源	2023 年 4 月 25 日	5,378,625.00	52,500	14	3.40	7,111.72	-	-
华泰证券	20230515000 01569	药明康德	2023 年 5 月 15 日	4,369,599.00	63,300	14	3.20	5,437.74	-	-
华泰证券	20230601000 01682	药明康德	2023 年 6 月 1 日	67,100.00	1,000	14	3.20	83.44	-	-
华泰证券	20230615000 32058	药明康德	2023 年 6 月 15 日	70,900.00	1,000	14	3.20	88.20	-	-
华泰证券	20230103000 30257	亿联网络	2023 年 1 月 3 日	2,028,768.00	33,600	14	3.40	2,682.54	-	-
华泰证券	20230117000 32453	亿联网络	2023 年 1 月 17 日	2,054,976.00	33,600	14	3.40	2,717.12	-	-
华泰证券	20230202000 01435	亿联网络	2023 年 2 月 2 日	6,172,000.00	100,000	14	3.40	8,160.74	-	-
华泰证券	20230203000 00768	亿联网络	2023 年 2 月 3 日	3,146,000.00	50,000	14	3.40	4,159.68	-	-

华泰证券	20230216000 13743	亿联网络	2023 年 2 月 16 日	7,041,000.00	100,000	14	3.40	9,309.72	-	-
华泰证券	20230221000 00549	亿联网络	2023 年 2 月 21 日	795,960.00	12,000	14	3.40	1,052.38	-	-
华泰证券	20230223000 00571	亿联网络	2023 年 2 月 23 日	330,150.00	5,000	14	3.40	436.52	-	-
华泰证券	20230309000 06520	亿联网络	2023 年 3 月 9 日	345,850.00	5,000	14	3.40	457.24	-	-
华泰证券	20230313000 00711	亿联网络	2023 年 3 月 13 日	3,445,500.00	50,000	14	3.40	4,555.74	-	-
华泰证券	20230320000 00537	亿联网络	2023 年 3 月 20 日	178,200.00	2,200	14	3.40	235.62	-	-
华泰证券	20230323000 05896	亿联网络	2023 年 3 月 23 日	425,250.00	5,000	14	3.40	562.24	-	-
华泰证券	20230327000 68019	亿联网络	2023 年 3 月 27 日	3,948,000.00	50,000	14	3.40	5,220.18	-	-
华泰证券	20230406000 12934	亿联网络	2023 年 4 月 6 日	352,600.00	5,000	14	3.40	466.20	-	-
华泰证券	20230410000 61773	亿联网络	2023 年 4 月 10 日	3,468,000.00	50,000	14	3.40	4,585.42	-	-
华泰证券	20230420000 09157	亿联网络	2023 年 4 月 20 日	309,800.00	5,000	14	3.40	409.64	-	-
华泰证券	20230504000 37883	亿联网络	2023 年 5 月 4 日	312,150.00	5,000	14	3.40	412.72	-	-
华泰证券	20230518000 38840	亿联网络	2023 年 5 月 18 日	274,300.00	5,000	14	3.40	362.74	-	-
华泰证券	20230601000 27675	亿联网络	2023 年 6 月 1 日	270,650.00	5,000	14	3.40	357.84	-	-
华泰证券	20230615000 27492	亿联网络	2023 年 6 月 15 日	188,300.00	5,000	14	3.40	248.92	-	-
华泰证券	20230629000 45092	亿联网络	2023 年 6 月 29 日	168,750.00	5,000	14	3.40	15.94	175,350.00	15.94
华泰证券	20230223000 00561	亿纬锂能	2023 年 2 月 23 日	372,200.00	5,000	14	3.40	492.10	-	-
华泰证券	20230309000 06516	亿纬锂能	2023 年 3 月 9 日	345,250.00	5,000	14	3.40	456.54	-	-
华泰证券	20230323000 07010	亿纬锂能	2023 年 3 月 23 日	338,250.00	5,000	14	3.40	447.30	-	-
华泰证券	20230406000 13002	亿纬锂能	2023 年 4 月 6 日	336,250.00	5,000	14	3.40	444.64	-	-
华泰证券	20230420000 12485	亿纬锂能	2023 年 4 月 20 日	322,700.00	5,000	14	3.40	426.72	-	-
华泰证券	20230504000	亿纬锂能	2023 年 5 月 4	325,900.00	5,000	14	3.40	430.92	-	-

	24195		日							
华泰证券	20230518000 40406	亿纬锂能	2023 年 5 月 18 日	340,650.00	5,000	14	3.40	450.38	-	-
华泰证券	20230601000 23758	亿纬锂能	2023 年 6 月 1 日	317,400.00	5,000	14	3.40	419.72	-	-
华泰证券	20230608000 02324	亿纬锂能	2023 年 6 月 8 日	17,907,000.00	300,000	14	3.40	30,441.96	-	-
华泰证券	20230615000 32117	亿纬锂能	2023 年 6 月 15 日	300,450.00	5,000	14	3.40	397.32	-	-
华泰证券	20230626000 01460	亿纬锂能	2023 年 6 月 26 日	9,877,556.00	168,100	14	3.40	3,731.52	10,170,050 .00	3,731.52
华泰证券	20230626000 35082	亿纬锂能	2023 年 6 月 26 日	17,628,000.00	300,000	14	3.40	6,659.48	18,150,000 .00	6,659.48
华泰证券	20230629000 07823	亿纬锂能	2023 年 6 月 29 日	366,336.00	6,400	14	3.40	34.60	387,200.00	34.60
华泰证券	20230629000 39936	亿纬锂能	2023 年 6 月 29 日	286,200.00	5,000	14	3.40	27.03	302,500.00	27.03
华泰证券	20230602000 01063	永兴材料	2023 年 6 月 2 日	239,868.00	3,600	14	3.20	298.48	-	-
华泰证券	20230605000 01028	永兴材料	2023 年 6 月 5 日	307,897.00	4,700	14	3.20	383.18	-	-
华泰证券	20230606000 02640	永兴材料	2023 年 6 月 6 日	1,255,576.00	19,600	14	3.20	1,562.54	-	-
华泰证券	20230607000 02501	永兴材料	2023 年 6 月 7 日	591,666.00	9,300	14	3.20	736.26	-	-
华泰证券	20230608000 02322	永兴材料	2023 年 6 月 8 日	317,275.00	4,900	14	3.20	507.60	-	-
华泰证券	20230612000 22626	永兴材料	2023 年 6 月 12 日	1,170,442.00	18,200	14	3.20	1,456.56	-	-
华泰证券	20230613000 02617	永兴材料	2023 年 6 月 13 日	116,334.00	1,800	14	3.20	144.76	-	-
华泰证券	20230616000 20350	永兴材料	2023 年 6 月 16 日	237,564.00	3,600	14	3.20	295.68	-	-
华泰证券	20230619000 01104	永兴材料	2023 年 6 月 19 日	280,403.00	4,300	14	3.20	274.23	269,223.00	274.23
华泰证券	20230619000 18397	永兴材料	2023 年 6 月 19 日	306,487.00	4,700	14	3.20	299.64	294,267.00	299.64
华泰证券	20230620000 33658	永兴材料	2023 年 6 月 20 日	1,265,768.00	19,600	14	3.20	1,125.10	1,227,156. 00	1,125.10
华泰证券	20230621000 12836	永兴材料	2023 年 6 月 21 日	590,085.00	9,300	14	3.20	472.05	582,273.00	472.05
华泰证券	20230626000 34638	永兴材料	2023 年 6 月 26 日	302,428.00	4,900	14	3.20	107.52	306,789.00	107.52

华泰证券	20230626000 40891	永兴材料	2023 年 6 月 26 日	1,123,304.00	18,200	14	3.20	399.40	1,139,502.00	399.40
华泰证券	20230627000 21849	永兴材料	2023 年 6 月 27 日	112,068.00	1,800	14	3.20	29.88	112,698.00	29.88
华泰证券	20230630000 14794	永兴材料	2023 年 6 月 30 日	225,396.00	3,600	14	3.20	-	225,396.00	-
华泰证券	20230530000 16214	邮储银行	2023 年 5 月 30 日	238,160.00	45,800	7	1.80	83.37	-	-
华泰证券	20230529000 01325	邮储银行	2023 年 5 月 29 日	1,154,130.00	219,000	14	1.80	807.94	-	-
华泰证券	20230529000 01339	邮储银行	2023 年 5 月 29 日	387,345.00	73,500	14	1.80	271.18	-	-
华泰证券	20230606000 14137	邮储银行	2023 年 6 月 6 日	239,076.00	45,800	7	1.80	83.65	-	-
华泰证券	20230613000 21856	邮储银行	2023 年 6 月 13 日	250,984.00	45,800	7	1.80	87.85	-	-
华泰证券	20230612000 22899	邮储银行	2023 年 6 月 12 日	1,195,740.00	219,000	14	1.80	837.06	-	-
华泰证券	20230620000 10342	邮储银行	2023 年 6 月 20 日	228,084.00	45,800	7	1.80	79.80	-	-
华泰证券	20230627000 19940	邮储银行	2023 年 6 月 27 日	227,168.00	45,800	7	1.80	34.08	223,962.00	34.08
华泰证券	20230626000 39723	邮储银行	2023 年 6 月 26 日	1,068,720.00	219,000	14	1.80	213.76	1,070,910.00	213.76
华泰证券	20230612000 22709	云南白药	2023 年 6 月 12 日	52,750.00	1,000	14	3.20	65.66	-	-
华泰证券	20230626000 52104	云南白药	2023 年 6 月 26 日	50,640.00	1,000	14	3.20	18.00	52,480.00	18.00
华泰证券	20230613000 02611	韵达股份	2023 年 6 月 13 日	33,524.00	3,400	14	3.20	41.72	-	-
华泰证券	20230616000 02173	韵达股份	2023 年 6 月 16 日	10,080.00	1,000	14	3.20	12.60	-	-
华泰证券	20230619000 01106	韵达股份	2023 年 6 月 19 日	60,939.00	6,100	14	3.20	59.62	58,316.00	59.62
华泰证券	20230627000 20875	韵达股份	2023 年 6 月 27 日	32,436.00	3,400	14	3.20	8.64	32,504.00	8.64
华泰证券	20230630000 18800	韵达股份	2023 年 6 月 30 日	9,560.00	1,000	14	3.20	-	9,560.00	-
华泰证券	20230522000 01191	长安汽车	2023 年 5 月 22 日	610,500.00	50,000	14	3.20	759.78	-	-
华泰证券	20230525000 02824	长安汽车	2023 年 5 月 25 日	49,323.00	4,100	14	3.20	61.32	-	-
华泰证券	20230526000	长安汽车	2023 年 5 月	50,266.00	4,100	14	3.20	62.58	-	-

	01376		26 日							
华泰证券	20230529000 01359	长安汽车	2023 年 5 月 29 日	953,608.00	79,600	14	3.20	1,186.78	-	-
华泰证券	20230605000 20200	长安汽车	2023 年 6 月 5 日	602,000.00	50,000	14	3.20	749.14	-	-
华泰证券	20230608000 16663	长安汽车	2023 年 6 月 8 日	47,683.00	4,100	14	3.20	76.32	-	-
华泰证券	20230609000 10804	长安汽车	2023 年 6 月 9 日	49,487.00	4,100	14	3.20	74.80	-	-
华泰证券	20230612000 41765	长安汽车	2023 年 6 月 12 日	967,140.00	79,600	14	3.20	1,203.58	-	-
华泰证券	20230619000 20898	长安汽车	2023 年 6 月 19 日	629,000.00	50,000	14	3.20	615.01	646,500.00	615.01
华泰证券	20230626000 31550	长安汽车	2023 年 6 月 26 日	1,022,860.00	79,600	14	3.20	363.68	1,029,228.00	363.68
华泰证券	20230626000 38145	长安汽车	2023 年 6 月 26 日	52,685.00	4,100	14	3.20	18.72	53,013.00	18.72
华泰证券	20230626000 38432	长安汽车	2023 年 6 月 26 日	52,685.00	4,100	14	3.20	18.72	53,013.00	18.72
华泰证券	20230530000 16238	长城汽车	2023 年 5 月 30 日	172,500.00	7,500	14	3.20	214.62	-	-
华泰证券	20230602000 01089	长城汽车	2023 年 6 月 2 日	719,190.00	30,500	14	3.20	895.02	-	-
华泰证券	20230605000 01058	长城汽车	2023 年 6 月 5 日	163,800.00	7,000	14	3.20	203.84	-	-
华泰证券	20230613000 21050	长城汽车	2023 年 6 月 13 日	180,450.00	7,500	14	3.20	224.56	-	-
华泰证券	20230616000 18512	长城汽车	2023 年 6 月 16 日	757,925.00	30,500	14	3.20	943.18	-	-
华泰证券	20230619000 22971	长城汽车	2023 年 6 月 19 日	177,520.00	7,000	14	3.20	173.58	176,190.00	173.58
华泰证券	20230627000 16539	长城汽车	2023 年 6 月 27 日	188,250.00	7,500	14	3.20	50.19	188,775.00	50.19
华泰证券	20230630000 15306	长城汽车	2023 年 6 月 30 日	767,685.00	30,500	14	3.20	-	767,685.00	-
华泰证券	20230530000 16186	长江电力	2023 年 5 月 30 日	313,950.00	13,800	7	1.80	109.90	-	-
华泰证券	20230529000 01382	长江电力	2023 年 5 月 29 日	240,345.00	10,500	14	1.80	168.28	-	-
华泰证券	20230529000 01393	长江电力	2023 年 5 月 29 日	732,480.00	32,000	14	1.80	512.68	-	-
华泰证券	20230606000 15963	长江电力	2023 年 6 月 6 日	308,016.00	13,800	7	1.80	107.80	-	-

华泰证券	20230613000 22277	长江电力	2023 年 6 月 13 日	307,740.00	13,800	7	1.80	107.73	-	-
华泰证券	20230612000 22892	长江电力	2023 年 6 月 12 日	716,160.00	32,000	14	1.80	501.34	-	-
华泰证券	20230620000 10261	长江电力	2023 年 6 月 20 日	304,842.00	13,800	7	1.80	106.68	-	-
华泰证券	20230627000 21134	长江电力	2023 年 6 月 27 日	305,256.00	13,800	7	1.80	45.78	304,428.00	45.78
华泰证券	20230626000 31037	长江电力	2023 年 6 月 26 日	711,680.00	32,000	14	1.80	142.32	705,920.00	142.32
华泰证券	20230616000 02215	招商轮船	2023 年 6 月 16 日	404,826.00	65,400	14	3.20	503.72	-	-
华泰证券	20230530000 16168	招商蛇口	2023 年 5 月 30 日	225,808.00	17,600	7	1.80	79.03	-	-
华泰证券	20230529000 01257	招商蛇口	2023 年 5 月 29 日	309,190.00	24,500	14	1.80	216.44	-	-
华泰证券	20230529000 01381	招商蛇口	2023 年 5 月 29 日	888,448.00	70,400	14	1.80	621.88	-	-
华泰证券	20230606000 20789	招商蛇口	2023 年 6 月 6 日	227,920.00	17,600	7	1.80	79.80	-	-
华泰证券	20230613000 18428	招商蛇口	2023 年 6 月 13 日	240,768.00	17,600	7	1.80	84.28	-	-
华泰证券	20230612000 22465	招商蛇口	2023 年 6 月 12 日	946,176.00	70,400	14	1.80	662.34	-	-
华泰证券	20230612000 22638	招商蛇口	2023 年 6 月 12 日	81,984.00	6,100	14	3.20	102.06	-	-
华泰证券	20230620000 10240	招商蛇口	2023 年 6 月 20 日	231,792.00	17,600	7	1.80	81.13	-	-
华泰证券	20230616000 02175	招商蛇口	2023 年 6 月 16 日	2,688,000.00	200,000	14	3.20	3,345.02	-	-
华泰证券	20230619000 01102	招商蛇口	2023 年 6 月 19 日	2,950,808.00	221,200	14	3.20	2,885.19	2,882,236.00	2,885.19
华泰证券	20230627000 19855	招商蛇口	2023 年 6 月 27 日	238,480.00	17,600	7	1.80	35.76	229,328.00	35.76
华泰证券	20230626000 50654	招商蛇口	2023 年 6 月 26 日	77,287.00	6,100	14	3.20	27.48	79,483.00	27.48
华泰证券	20230626000 51461	招商蛇口	2023 年 6 月 26 日	891,968.00	70,400	14	1.80	178.40	917,312.00	178.40
华泰证券	20230627000 04529	招商蛇口	2023 年 6 月 27 日	243,900.00	18,000	14	3.20	65.04	234,540.00	65.04
华泰证券	20230630000 20940	招商蛇口	2023 年 6 月 30 日	2,606,000.00	200,000	14	3.20	-	2,606,000.00	-
华泰证券	20230530000	招商银行	2023 年 5 月	476,544.00	14,600	7	1.80	166.81	-	-

	16206		30 日							
华泰证券	20230529000 01399	招商银行	2023 年 5 月 29 日	228,830.00	7,000	14	1.80	160.16	-	-
华泰证券	20230529000 01439	招商银行	2023 年 5 月 29 日	653,800.00	20,000	14	1.80	457.66	-	-
华泰证券	20230606000 14037	招商银行	2023 年 6 月 6 日	482,822.00	14,600	7	1.80	168.98	-	-
华泰证券	20230613000 21855	招商银行	2023 年 6 月 13 日	492,458.00	14,600	7	1.80	172.34	-	-
华泰证券	20230612000 22980	招商银行	2023 年 6 月 12 日	674,600.00	20,000	14	1.80	472.22	-	-
华泰证券	20230620000 10282	招商银行	2023 年 6 月 20 日	484,574.00	14,600	7	1.80	169.61	-	-
华泰证券	20230627000 21636	招商银行	2023 年 6 月 27 日	479,172.00	14,600	7	1.80	71.88	478,296.00	71.88
华泰证券	20230626000 32673	招商银行	2023 年 6 月 26 日	652,200.00	20,000	14	1.80	130.44	655,200.00	130.44
华泰证券	20230602000 01065	振华科技	2023 年 6 月 2 日	4,482,500.00	50,000	14	3.20	5,578.16	-	-
华泰证券	20230613000 02591	振华科技	2023 年 6 月 13 日	15,417,880.00	188,000	14	3.20	9,593.36	-	-
华泰证券	20230620000 23901	振华科技	2023 年 6 月 13 日	15,417,880.00	188,000	8	3.20	1,370.48	-	-
华泰证券	20230606000 02613	正泰电器	2023 年 6 月 6 日	971,520.00	36,800	14	3.20	1,209.04	-	-
华泰证券	20230607000 02527	正泰电器	2023 年 6 月 7 日	414,092.00	16,100	14	3.20	515.34	-	-
华泰证券	20230620000 30450	正泰电器	2023 年 6 月 20 日	999,120.00	36,800	14	3.20	888.10	1,017,520.00	888.10
华泰证券	20230621000 14484	正泰电器	2023 年 6 月 21 日	434,700.00	16,100	14	3.20	347.76	445,165.00	347.76
华泰证券	20230516000 01504	中国船舶	2023 年 5 月 16 日	2,729,324.00	94,900	14	3.20	3,396.54	-	-
华泰证券	20230517000 01747	中国船舶	2023 年 5 月 17 日	1,204,604.00	40,100	14	3.40	1,592.78	-	-
华泰证券	20230518000 01288	中国船舶	2023 年 5 月 18 日	2,995,000.00	100,000	14	3.40	3,960.04	-	-
华泰证券	20230522000 01195	中国船舶	2023 年 5 月 22 日	1,342,080.00	46,600	14	3.20	1,670.20	-	-
华泰证券	20230524000 01869	中国船舶	2023 年 5 月 24 日	513,930.00	18,500	14	3.40	679.56	-	-
华泰证券	20230529000 01433	中国船舶	2023 年 5 月 29 日	374,874.00	12,900	14	3.20	466.48	-	-

华泰证券	20230530000 20901	中国船舶	2023 年 5 月 30 日	2,759,692.00	94,900	14	3.20	3,434.34	-	-
华泰证券	20230531000 01641	中国船舶	2023 年 5 月 31 日	317,020.00	11,000	14	3.20	394.52	-	-
华泰证券	20230531000 08330	中国船舶	2023 年 5 月 31 日	1,155,682.00	40,100	14	3.40	1,528.10	-	-
华泰证券	20230601000 25024	中国船舶	2023 年 6 月 1 日	2,893,000.00	100,000	14	3.40	3,825.22	-	-
华泰证券	20230605000 21593	中国船舶	2023 年 6 月 5 日	1,334,624.00	46,600	14	3.20	1,660.82	-	-
华泰证券	20230607000 23720	中国船舶	2023 年 6 月 7 日	510,045.00	18,500	14	3.40	674.38	-	-
华泰证券	20230612000 39741	中国船舶	2023 年 6 月 12 日	357,975.00	12,900	14	3.20	445.48	-	-
华泰证券	20230613000 22286	中国船舶	2023 年 6 月 13 日	2,634,424.00	94,900	14	3.20	3,278.38	-	-
华泰证券	20230614000 48859	中国船舶	2023 年 6 月 14 日	305,360.00	11,000	14	3.20	379.96	-	-
华泰证券	20230614000 51545	中国船舶	2023 年 6 月 14 日	1,113,176.00	40,100	14	3.40	1,471.82	-	-
华泰证券	20230615000 27222	中国船舶	2023 年 6 月 15 日	2,750,000.00	100,000	14	3.40	3,636.08	-	-
华泰证券	20230619000 19862	中国船舶	2023 年 6 月 19 日	1,404,990.00	46,600	14	3.20	1,373.79	1,533,606. 00	1,373.79
华泰证券	20230621000 01984	中国船舶	2023 年 6 月 21 日	845,736.00	26,200	14	3.20	676.62	862,242.00	676.62
华泰证券	20230621000 13246	中国船舶	2023 年 6 月 21 日	597,180.00	18,500	14	3.40	507.60	608,835.00	507.60
华泰证券	20230626000 31028	中国船舶	2023 年 6 月 26 日	411,252.00	12,900	14	3.20	146.24	424,539.00	146.24
华泰证券	20230627000 18883	中国船舶	2023 年 6 月 27 日	3,121,261.00	94,900	14	3.20	832.35	3,123,159. 00	832.35
华泰证券	20230628000 47266	中国船舶	2023 年 6 月 28 日	356,510.00	11,000	14	3.20	63.38	362,010.00	63.38
华泰证券	20230628000 51746	中国船舶	2023 年 6 月 28 日	1,299,641.00	40,100	14	3.40	245.48	1,319,691. 00	245.48
华泰证券	20230629000 38478	中国船舶	2023 年 6 月 29 日	3,261,000.00	100,000	14	3.40	307.98	3,291,000. 00	307.98
华泰证券	20230523000 03206	中国电建	2023 年 5 月 23 日	2,407,578.00	355,100	14	3.20	2,996.14	-	-
华泰证券	20230601000 01690	中国电建	2023 年 6 月 1 日	100,646.00	15,800	14	3.20	125.30	-	-
华泰证券	20230606000	中国电建	2023 年 6 月 6	899,325.00	157,500	14	3.20	1,119.16	-	-

	02670		日							
华泰证券	2023060600016806	中国电建	2023 年 6 月 6 日	2,027,621.00	355,100	14	3.20	2,523.22	-	-
华泰证券	2023061400016385	中国电建	2023 年 6 月 14 日	735,065.00	130,100	14	3.20	914.76	-	-
华泰证券	2023061500027995	中国电建	2023 年 6 月 15 日	90,376.00	15,800	14	3.20	112.42	-	-
华泰证券	2023062000030555	中国电建	2023 年 6 月 20 日	905,625.00	157,500	14	3.20	805.00	904,050.00	805.00
华泰证券	2023062000031341	中国电建	2023 年 6 月 20 日	2,041,825.00	355,100	14	3.20	1,815.00	2,038,274.00	1,815.00
华泰证券	2023062800040198	中国电建	2023 年 6 月 28 日	748,075.00	130,100	14	3.20	133.00	746,774.00	133.00
华泰证券	2023062900043553	中国电建	2023 年 6 月 29 日	90,218.00	15,800	14	3.20	8.02	90,692.00	8.02
华泰证券	2023063000001514	中国电建	2023 年 6 月 30 日	1,148,000.00	200,000	14	3.20	-	1,148,000.00	-
华泰证券	2023042600001618	中国东航	2023 年 4 月 26 日	5,130,000.00	1,000,000	14	3.20	6,384.00	-	-
华泰证券	2023051000009482	中国东航	2023 年 5 月 10 日	4,950,000.00	1,000,000	14	3.20	6,160.00	-	-
华泰证券	2023051600001281	中国东航	2023 年 5 月 16 日	340,663.00	69,100	14	3.20	423.92	-	-
华泰证券	2023051700001751	中国东航	2023 年 5 月 17 日	9,780.00	2,000	14	3.50	13.30	-	-
华泰证券	2023052400015340	中国东航	2023 年 5 月 24 日	4,740,000.00	1,000,000	14	3.20	5,898.62	-	-
华泰证券	2023053000020865	中国东航	2023 年 5 月 30 日	326,152.00	69,100	14	3.20	405.86	-	-
华泰证券	2023053100009335	中国东航	2023 年 5 月 31 日	9,340.00	2,000	14	3.50	12.74	-	-
华泰证券	2023060100001699	中国东航	2023 年 6 月 1 日	457,000.00	100,000	14	3.50	622.02	-	-
华泰证券	2023060700022309	中国东航	2023 年 6 月 7 日	4,600,000.00	1,000,000	14	3.20	5,724.46	-	-
华泰证券	2023061300021635	中国东航	2023 年 6 月 13 日	327,534.00	69,100	14	3.20	407.54	-	-
华泰证券	2023061400050990	中国东航	2023 年 6 月 14 日	9,400.00	2,000	14	3.50	12.74	-	-
华泰证券	2023061500028541	中国东航	2023 年 6 月 15 日	473,000.00	100,000	14	3.50	643.86	-	-
华泰证券	2023062100014063	中国东航	2023 年 6 月 21 日	4,740,000.00	1,000,000	14	3.20	3,791.97	4,760,000.00	3,791.97

华泰证券	2023062700015976	中国东航	2023 年 6 月 27 日	330,989.00	69,100	14	3.20	88.26	328,916.00	88.26
华泰证券	2023062800045589	中国东航	2023 年 6 月 28 日	9,700.00	2,000	14	3.50	1.88	9,520.00	1.88
华泰证券	2023062900039544	中国东航	2023 年 6 月 29 日	472,000.00	100,000	14	3.50	45.89	476,000.00	45.89
华泰证券	2023053000016148	中国广核	2023 年 5 月 30 日	87,570.00	27,800	7	1.80	30.66	-	-
华泰证券	2023052900001271	中国广核	2023 年 5 月 29 日	232,260.00	73,500	14	1.80	162.54	-	-
华泰证券	2023052900001387	中国广核	2023 年 5 月 29 日	1,314,560.00	416,000	14	1.80	920.22	-	-
华泰证券	2023060600015209	中国广核	2023 年 6 月 6 日	83,400.00	27,800	7	1.80	29.19	-	-
华泰证券	2023061300018926	中国广核	2023 年 6 月 13 日	85,346.00	27,800	7	1.80	29.89	-	-
华泰证券	2023061200022469	中国广核	2023 年 6 月 12 日	1,277,120.00	416,000	14	1.80	894.04	-	-
华泰证券	2023062000010243	中国广核	2023 年 6 月 20 日	83,956.00	27,800	7	1.80	29.40	-	-
华泰证券	2023062700021013	中国广核	2023 年 6 月 27 日	85,902.00	27,800	7	1.80	12.90	86,458.00	12.90
华泰证券	2023062600040096	中国广核	2023 年 6 月 26 日	1,260,480.00	416,000	14	1.80	252.08	1,293,760.00	252.08
华泰证券	2023052200001217	中国国航	2023 年 5 月 22 日	963,000.00	100,000	14	3.50	1,310.82	-	-
华泰证券	2023052300003210	中国国航	2023 年 5 月 23 日	927,000.00	100,000	14	3.20	1,153.60	-	-
华泰证券	2023052400001893	中国国航	2023 年 5 月 24 日	891,000.00	100,000	14	3.40	1,178.10	-	-
华泰证券	2023052500002812	中国国航	2023 年 5 月 25 日	888,000.00	100,000	14	3.50	1,208.62	-	-
华泰证券	2023052600001396	中国国航	2023 年 5 月 26 日	2,340,828.00	265,400	14	3.50	3,186.12	-	-
华泰证券	2023052900001449	中国国航	2023 年 5 月 29 日	79,290.00	9,000	14	3.20	98.70	-	-
华泰证券	2023053000016236	中国国航	2023 年 5 月 30 日	95,810.00	11,000	14	3.20	119.28	-	-
华泰证券	2023053100001653	中国国航	2023 年 5 月 31 日	235,440.00	27,000	14	3.20	293.02	-	-
华泰证券	2023060200001105	中国国航	2023 年 6 月 2 日	652,000.00	80,000	14	3.20	811.44	-	-
华泰证券	20230605000	中国国航	2023 年 6 月 5 日	206,500.00	25,000	14	3.20	257.04	-	-

	01082		日							
华泰证券	2023060500018382	中国国航	2023年6月5日	826,000.00	100,000	14	3.50	1,124.34	-	-
华泰证券	2023060600002664	中国国航	2023年6月6日	1,364,160.00	168,000	14	3.20	1,697.64	-	-
华泰证券	2023060600019117	中国国航	2023年6月6日	812,000.00	100,000	14	3.20	1,010.52	-	-
华泰证券	2023060700023405	中国国航	2023年6月7日	809,000.00	100,000	14	3.40	1,069.74	-	-
华泰证券	2023060800016560	中国国航	2023年6月8日	815,000.00	100,000	14	3.50	1,426.32	-	-
华泰证券	2023060900011107	中国国航	2023年6月9日	2,181,588.00	265,400	14	3.50	3,605.70	-	-
华泰证券	2023061200038878	中国国航	2023年6月12日	75,330.00	9,000	14	3.20	93.80	-	-
华泰证券	2023061300021898	中国国航	2023年6月13日	92,070.00	11,000	14	3.20	114.52	-	-
华泰证券	2023061400049906	中国国航	2023年6月14日	223,020.00	27,000	14	3.20	277.48	-	-
华泰证券	2023061600018196	中国国航	2023年6月16日	680,000.00	80,000	14	3.20	846.16	-	-
华泰证券	2023061900020859	中国国航	2023年6月19日	214,000.00	25,000	14	3.20	209.22	206,000.00	209.22
华泰证券	2023061900021342	中国国航	2023年6月19日	856,000.00	100,000	14	3.50	915.42	824,000.00	915.42
华泰证券	2023062000030554	中国国航	2023年6月20日	1,414,560.00	168,000	14	3.20	1,257.40	1,384,320.00	1,257.40
华泰证券	2023062000032840	中国国航	2023年6月20日	842,000.00	100,000	14	3.20	748.40	824,000.00	748.40
华泰证券	2023062100014629	中国国航	2023年6月21日	843,000.00	100,000	14	3.40	716.58	824,000.00	716.58
华泰证券	2023062600034797	中国国航	2023年6月26日	2,168,318.00	265,400	14	3.50	843.24	2,186,896.00	843.24
华泰证券	2023062600036958	中国国航	2023年6月26日	817,000.00	100,000	14	3.50	317.72	824,000.00	317.72
华泰证券	2023062600043150	中国国航	2023年6月26日	73,530.00	9,000	14	3.20	26.16	74,160.00	26.16
华泰证券	2023062700018136	中国国航	2023年6月27日	91,300.00	11,000	14	3.20	24.36	90,640.00	24.36
华泰证券	2023062800052320	中国国航	2023年6月28日	227,880.00	27,000	14	3.20	40.52	222,480.00	40.52
华泰证券	2023063000014631	中国国航	2023年6月30日	659,200.00	80,000	14	3.20	-	659,200.00	-

华泰证券	20230530000 16184	中国建筑	2023 年 5 月 30 日	311, 112. 00	52, 200	7	1. 80	108. 92	-	-
华泰证券	20230529000 01327	中国建筑	2023 年 5 月 29 日	937, 280. 00	161, 600	14	1. 80	656. 04	-	-
华泰证券	20230529000 01335	中国建筑	2023 年 5 月 29 日	304, 500. 00	52, 500	14	1. 80	213. 22	-	-
华泰证券	20230606000 21622	中国建筑	2023 年 6 月 6 日	314, 244. 00	52, 200	7	1. 80	109. 97	-	-
华泰证券	20230613000 20188	中国建筑	2023 年 6 月 13 日	313, 200. 00	52, 200	7	1. 80	109. 62	-	-
华泰证券	20230612000 23096	中国建筑	2023 年 6 月 12 日	977, 680. 00	161, 600	14	1. 80	684. 32	-	-
华泰证券	20230620000 10305	中国建筑	2023 年 6 月 20 日	304, 848. 00	52, 200	7	1. 80	106. 68	-	-
华泰证券	20230627000 19574	中国建筑	2023 年 6 月 27 日	307, 980. 00	52, 200	7	1. 80	46. 20	299, 628. 00	46. 20
华泰证券	20230626000 48307	中国建筑	2023 年 6 月 26 日	919, 504. 00	161, 600	14	1. 80	183. 92	927, 584. 00	183. 92
华泰证券	20230519000 02283	中国能建	2023 年 5 月 19 日	91, 390. 00	37, 000	14	3. 20	113. 68	-	-
华泰证券	20230531000 01651	中国能建	2023 年 5 月 31 日	1, 406, 400. 00	586, 000	14	3. 20	1, 750. 14	-	-
华泰证券	20230601000 01684	中国能建	2023 年 6 月 1 日	1, 202, 640. 00	501, 100	14	3. 20	1, 496. 60	-	-
华泰证券	20230602000 11177	中国能建	2023 年 6 月 2 日	89, 170. 00	37, 000	14	3. 20	111. 02	-	-
华泰证券	20230614000 50826	中国能建	2023 年 6 月 14 日	1, 382, 960. 00	586, 000	14	3. 20	1, 721. 02	-	-
华泰证券	20230615000 28534	中国能建	2023 年 6 月 15 日	1, 182, 596. 00	501, 100	14	3. 20	1, 471. 68	-	-
华泰证券	20230616000 17721	中国能建	2023 年 6 月 16 日	87, 690. 00	37, 000	14	3. 20	109. 20	-	-
华泰证券	20230628000 53893	中国能建	2023 年 6 月 28 日	1, 365, 380. 00	586, 000	14	3. 20	242. 74	1, 371, 240. 00	242. 74
华泰证券	20230629000 40648	中国能建	2023 年 6 月 29 日	1, 162, 552. 00	501, 100	14	3. 20	103. 34	1, 172, 574. 00	103. 34
华泰证券	20230630000 16928	中国能建	2023 年 6 月 30 日	86, 580. 00	37, 000	14	3. 20	-	86, 580. 00	-
华泰证券	20230531000 01661	中国人寿	2023 年 5 月 31 日	3, 364, 334. 00	90, 100	14	3. 20	4, 186. 70	-	-
华泰证券	20230530000 16176	中国石化	2023 年 5 月 30 日	218, 655. 00	33, 900	7	1. 80	76. 51	-	-
华泰证券	20230529000	中国石化	2023 年 5 月	820, 260. 00	126, 000	14	1. 80	574. 14	-	-

	01397		29 日							
华泰证券	20230529000 01422	中国石化	2023 年 5 月 29 日	2,896,950.00	445,000	14	1.80	2,027.90	-	-
华泰证券	20230606000 15638	中国石化	2023 年 6 月 6 日	222,045.00	33,900	7	1.80	77.70	-	-
华泰证券	20230601000 01704	中国石化	2023 年 6 月 1 日	454,300.00	70,000	14	3.20	565.32	-	-
华泰证券	20230613000 20578	中国石化	2023 年 6 月 13 日	222,723.00	33,900	7	1.80	77.98	-	-
华泰证券	20230612000 22752	中国石化	2023 年 6 月 12 日	2,945,900.00	445,000	14	1.80	2,062.20	-	-
华泰证券	20230620000 10268	中国石化	2023 年 6 月 20 日	214,248.00	33,900	7	1.80	74.97	-	-
华泰证券	20230615000 30993	中国石化	2023 年 6 月 15 日	456,400.00	70,000	14	3.20	567.98	-	-
华泰证券	20230627000 20748	中国石化	2023 年 6 月 27 日	210,858.00	33,900	7	1.80	31.62	215,604.00	31.62
华泰证券	20230626000 33152	中国石化	2023 年 6 月 26 日	2,701,150.00	445,000	14	1.80	540.24	2,830,200.00	540.24
华泰证券	20230629000 42911	中国石化	2023 年 6 月 29 日	441,000.00	70,000	14	3.20	39.20	445,200.00	39.20
华泰证券	20230530000 16212	中国石油	2023 年 5 月 30 日	257,712.00	33,600	7	1.80	90.23	-	-
华泰证券	20230529000 01295	中国石油	2023 年 5 月 29 日	1,224,534.00	160,700	14	1.80	857.22	-	-
华泰证券	20230529000 01348	中国石油	2023 年 5 月 29 日	400,050.00	52,500	14	1.80	280.00	-	-
华泰证券	20230606000 17350	中国石油	2023 年 6 月 6 日	257,376.00	33,600	7	1.80	90.09	-	-
华泰证券	20230613000 20488	中国石油	2023 年 6 月 13 日	255,696.00	33,600	7	1.80	89.46	-	-
华泰证券	20230612000 22785	中国石油	2023 年 6 月 12 日	1,250,246.00	160,700	14	1.80	875.14	-	-
华泰证券	20230620000 10330	中国石油	2023 年 6 月 20 日	247,632.00	33,600	7	1.80	86.66	-	-
华泰证券	20230627000 21366	中国石油	2023 年 6 月 27 日	259,728.00	33,600	7	1.80	38.97	250,992.00	38.97
华泰证券	20230626000 41881	中国石油	2023 年 6 月 26 日	1,198,822.00	160,700	14	1.80	239.76	1,200,429.00	239.76
华泰证券	20230530000 16172	中国铁建	2023 年 5 月 30 日	276,144.00	26,400	7	1.80	96.67	-	-
华泰证券	20230529000 01304	中国铁建	2023 年 5 月 29 日	762,280.00	76,000	14	1.80	533.54	-	-

华泰证券	20230529000 01413	中国铁建	2023 年 5 月 29 日	245,735.00	24,500	14	1.80	172.06	-	-
华泰证券	20230606000 17998	中国铁建	2023 年 6 月 6 日	267,960.00	26,400	7	1.80	93.80	-	-
华泰证券	20230613000 22173	中国铁建	2023 年 6 月 13 日	267,432.00	26,400	7	1.80	93.59	-	-
华泰证券	20230612000 22802	中国铁建	2023 年 6 月 12 日	784,320.00	76,000	14	1.80	549.08	-	-
华泰证券	20230620000 10289	中国铁建	2023 年 6 月 20 日	257,664.00	26,400	7	1.80	90.16	-	-
华泰证券	20230627000 21539	中国铁建	2023 年 6 月 27 日	259,248.00	26,400	7	1.80	38.88	260,040.00	38.88
华泰证券	20230626000 39678	中国铁建	2023 年 6 月 26 日	710,600.00	76,000	14	1.80	142.12	748,600.00	142.12
华泰证券	20230511000 01790	中国卫通	2023 年 5 月 11 日	217,437.00	12,100	14	3.20	270.62	-	-
华泰证券	20230519000 02295	中国卫通	2023 年 5 月 19 日	139,520.00	8,000	14	3.40	184.52	-	-
华泰证券	20230524000 01899	中国卫通	2023 年 5 月 24 日	852,000.00	50,000	14	3.40	1,126.58	-	-
华泰证券	20230525000 07428	中国卫通	2023 年 5 月 25 日	205,942.00	12,100	14	3.20	256.34	-	-
华泰证券	20230529000 01447	中国卫通	2023 年 5 月 29 日	1,738,800.00	100,800	14	3.20	2,163.84	-	-
华泰证券	20230530000 16230	中国卫通	2023 年 5 月 30 日	36,020.00	2,000	14	3.20	44.80	-	-
华泰证券	20230602000 01075	中国卫通	2023 年 6 月 2 日	256,340.00	14,000	14	3.20	319.06	-	-
华泰证券	20230602000 10750	中国卫通	2023 年 6 月 2 日	146,480.00	8,000	14	3.40	193.62	-	-
华泰证券	20230605000 01104	中国卫通	2023 年 6 月 5 日	72,480.00	4,000	14	3.20	90.16	-	-
华泰证券	20230607000 22434	中国卫通	2023 年 6 月 7 日	878,500.00	50,000	14	3.40	1,161.58	-	-
华泰证券	20230608000 21683	中国卫通	2023 年 6 月 8 日	209,572.00	12,100	14	3.20	335.34	-	-
华泰证券	20230612000 38790	中国卫通	2023 年 6 月 12 日	1,760,976.00	100,800	14	3.20	2,191.42	-	-
华泰证券	20230613000 20008	中国卫通	2023 年 6 月 13 日	35,900.00	2,000	14	3.20	44.66	-	-
华泰证券	20230616000 18684	中国卫通	2023 年 6 月 16 日	146,320.00	8,000	14	3.40	193.48	-	-
华泰证券	20230616000	中国卫通	2023 年 6 月	256,060.00	14,000	14	3.20	318.64	-	-

	20880		16 日							
华泰证券	20230619000 19682	中国卫通	2023 年 6 月 19 日	75,200.00	4,000	14	3.20	73.48	79,520.00	73.48
华泰证券	20230621000 15564	中国卫通	2023 年 6 月 21 日	977,500.00	50,000	14	3.40	830.88	994,000.00	830.88
华泰证券	20230626000 36313	中国卫通	2023 年 6 月 26 日	248,171.00	12,100	14	3.20	88.24	240,548.00	88.24
华泰证券	20230626000 37923	中国卫通	2023 年 6 月 26 日	2,067,408.00	100,800	14	3.20	735.08	2,003,904.00	735.08
华泰证券	20230627000 04545	中国卫通	2023 年 6 月 27 日	36,601.00	1,700	14	3.20	9.75	33,796.00	9.75
华泰证券	20230627000 20203	中国卫通	2023 年 6 月 27 日	43,060.00	2,000	14	3.20	11.49	39,760.00	11.49
华泰证券	20230630000 15084	中国卫通	2023 年 6 月 30 日	159,040.00	8,000	14	3.40	-	159,040.00	-
华泰证券	20230630000 16483	中国卫通	2023 年 6 月 30 日	278,320.00	14,000	14	3.20	-	278,320.00	-
华泰证券	20230519000 02301	中国银河	2023 年 5 月 19 日	1,210,000.00	100,000	14	3.20	1,505.84	-	-
华泰证券	20230602000 12594	中国银河	2023 年 6 月 2 日	1,157,000.00	100,000	14	3.20	1,439.76	-	-
华泰证券	20230616000 02217	中国银河	2023 年 6 月 16 日	609,500.00	50,000	14	3.20	758.52	-	-
华泰证券	20230626000 01449	中国银河	2023 年 6 月 26 日	3,132,660.00	287,400	14	3.20	1,113.84	3,336,714.00	1,113.84
华泰证券	20230630000 21369	中国银河	2023 年 6 月 30 日	580,500.00	50,000	14	3.20	-	580,500.00	-
华泰证券	20230530000 16202	中国银行	2023 年 5 月 30 日	170,955.00	43,500	7	1.80	59.85	-	-
华泰证券	20230529000 01311	中国银行	2023 年 5 月 29 日	1,837,566.00	461,700	14	1.80	1,286.32	-	-
华泰证券	20230529000 01361	中国银行	2023 年 5 月 29 日	598,990.00	150,500	14	1.80	419.30	-	-
华泰证券	20230606000 17669	中国银行	2023 年 6 月 6 日	173,565.00	43,500	7	1.80	60.76	-	-
华泰证券	20230613000 21677	中国银行	2023 年 6 月 13 日	176,610.00	43,500	7	1.80	61.81	-	-
华泰证券	20230612000 22992	中国银行	2023 年 6 月 12 日	1,865,268.00	461,700	14	1.80	1,305.64	-	-
华泰证券	20230620000 10314	中国银行	2023 年 6 月 20 日	168,345.00	43,500	7	1.80	58.94	-	-
华泰证券	20230627000 20667	中国银行	2023 年 6 月 27 日	167,910.00	43,500	7	1.80	25.20	170,085.00	25.20

华泰证券	2023062600032756	中国银行	2023 年 6 月 26 日	1,745,226.00	461,700	14	1.80	349.04	1,805,247.00	349.04
华泰证券	2023053000016207	中国中车	2023 年 5 月 30 日	587,275.00	84,500	7	1.80	205.52	-	-
华泰证券	2023052900001277	中国中车	2023 年 5 月 29 日	767,448.00	118,800	14	1.80	537.18	-	-
华泰证券	2023052900001379	中国中车	2023 年 5 月 29 日	248,710.00	38,500	14	1.80	174.16	-	-
华泰证券	2023060600017132	中国中车	2023 年 6 月 6 日	560,235.00	84,500	7	1.80	196.07	-	-
华泰证券	2023053100001643	中国中车	2023 年 5 月 31 日	1,337,600.00	190,000	14	3.20	1,664.60	-	-
华泰证券	2023061300019995	中国中车	2023 年 6 月 13 日	543,335.00	84,500	7	1.80	190.19	-	-
华泰证券	2023061200023155	中国中车	2023 年 6 月 12 日	775,764.00	118,800	14	1.80	543.06	-	-
华泰证券	2023062000010287	中国中车	2023 年 6 月 20 日	541,645.00	84,500	7	1.80	189.56	-	-
华泰证券	2023061400050898	中国中车	2023 年 6 月 14 日	1,217,900.00	190,000	14	3.20	1,515.64	-	-
华泰证券	2023062700020956	中国中车	2023 年 6 月 27 日	544,180.00	84,500	7	1.80	81.63	549,250.00	81.63
华泰证券	2023062600031939	中国中车	2023 年 6 月 26 日	737,748.00	118,800	14	1.80	147.56	772,200.00	147.56
华泰证券	2023062800042176	中国中车	2023 年 6 月 28 日	1,223,600.00	190,000	14	3.20	217.52	1,235,000.00	217.52
华泰证券	2023053000016200	中国中铁	2023 年 5 月 30 日	225,869.00	28,700	7	1.80	79.03	-	-
华泰证券	2023052900001308	中国中铁	2023 年 5 月 29 日	1,793,050.00	235,000	14	1.80	1,255.10	-	-
华泰证券	2023052900001371	中国中铁	2023 年 5 月 29 日	293,755.00	38,500	14	1.80	205.66	-	-
华泰证券	2023060600015000	中国中铁	2023 年 6 月 6 日	225,582.00	28,700	7	1.80	78.96	-	-
华泰证券	2023061300021022	中国中铁	2023 年 6 月 13 日	217,259.00	28,700	7	1.80	76.02	-	-
华泰证券	2023061200023167	中国中铁	2023 年 6 月 12 日	1,844,750.00	235,000	14	1.80	1,291.36	-	-
华泰证券	2023062000010322	中国中铁	2023 年 6 月 20 日	210,084.00	28,700	7	1.80	73.50	-	-
华泰证券	2023062700021195	中国中铁	2023 年 6 月 27 日	215,824.00	28,700	7	1.80	32.37	217,546.00	32.37
华泰证券	20230626000	中国中铁	2023 年 6 月	1,663,800.00	235,000	14	1.80	332.76	1,781,300.	332.76

	33111		26 日						00	
华泰证券	20230516000 01273	中金公司	2023 年 5 月 16 日	19,858,500.00	450,000	14	3.20	24,712.80	-	-
华泰证券	20230519000 02305	中金公司	2023 年 5 月 19 日	2,408,700.00	55,500	14	3.20	2,997.54	-	-
华泰证券	20230530000 20861	中金公司	2023 年 5 月 30 日	18,184,500.00	450,000	14	3.20	22,629.60	-	-
华泰证券	20230602000 10853	中金公司	2023 年 6 月 2 日	2,261,625.00	55,500	14	3.20	2,814.42	-	-
华泰证券	20230613000 02639	中金公司	2023 年 6 月 13 日	11,775,000.00	300,000	14	3.20	14,653.38	-	-
华泰证券	20230614000 16396	中金公司	2023 年 6 月 14 日	5,866,500.00	150,000	14	3.20	7,300.58	-	-
华泰证券	20230616000 19357	中金公司	2023 年 6 月 16 日	2,214,450.00	55,500	14	3.20	2,755.76	-	-
华泰证券	20230627000 20643	中金公司	2023 年 6 月 27 日	10,764,000.00	300,000	14	3.20	2,870.40	10,656,000.00	2,870.40
华泰证券	20230628000 54973	中金公司	2023 年 6 月 28 日	5,272,500.00	150,000	14	3.20	937.34	5,328,000.00	937.34
华泰证券	20230630000 16516	中金公司	2023 年 6 月 30 日	1,971,360.00	55,500	14	3.20	-	1,971,360.00	-
华泰证券	20230103000 27975	中科创达	2023 年 1 月 3 日	5,175,500.00	50,000	14	3.40	6,843.20	-	-
华泰证券	20230103000 29365	中科创达	2023 年 1 月 3 日	103,510.00	1,000	14	3.40	136.92	-	-
华泰证券	20230105000 17557	中科创达	2023 年 1 月 5 日	1,794,408.00	16,800	14	3.40	2,372.58	-	-
华泰证券	20230109000 37518	中科创达	2023 年 1 月 9 日	549,848.00	5,200	14	3.40	1,090.53	-	-
华泰证券	20230117000 00188	中科创达	2023 年 1 月 17 日	189,954.00	1,800	14	3.40	251.16	-	-
华泰证券	20230117000 31771	中科创达	2023 年 1 月 17 日	105,530.00	1,000	14	3.40	139.58	-	-
华泰证券	20230117000 31795	中科创达	2023 年 1 月 17 日	5,276,500.00	50,000	14	3.40	6,976.76	-	-
华泰证券	20230119000 15668	中科创达	2023 年 1 月 19 日	1,780,800.00	16,800	14	3.40	2,354.66	-	-
华泰证券	20230130000 72083	中科创达	2023 年 1 月 30 日	579,124.00	5,200	14	3.40	765.80	-	-
华泰证券	20230131000 26921	中科创达	2023 年 1 月 31 日	197,514.00	1,800	14	3.40	261.10	-	-
华泰证券	20230131000 27063	中科创达	2023 年 1 月 31 日	5,486,500.00	50,000	14	3.40	7,254.38	-	-

华泰证券	20230131000 27069	中科创达	2023 年 1 月 31 日	109,730.00	1,000	14	3.40	145.04	-	-
华泰证券	20230202000 12965	中科创达	2023 年 2 月 2 日	1,914,528.00	16,800	14	3.40	2,531.48	-	-
华泰证券	20230213000 79550	中科创达	2023 年 2 月 13 日	523,432.00	5,200	14	3.40	692.16	-	-
华泰证券	20230214000 23959	中科创达	2023 年 2 月 14 日	5,045,000.00	50,000	14	3.40	6,670.58	-	-
华泰证券	20230214000 23963	中科创达	2023 年 2 月 14 日	100,900.00	1,000	14	3.40	133.42	-	-
华泰证券	20230214000 23965	中科创达	2023 年 2 月 14 日	181,620.00	1,800	14	3.40	240.10	-	-
华泰证券	20230216000 13713	中科创达	2023 年 2 月 16 日	1,629,768.00	16,800	14	3.40	2,154.88	-	-
华泰证券	20230227000 00575	中科创达	2023 年 2 月 27 日	4,699,000.00	50,000	14	3.20	5,847.66	-	-
华泰证券	20230227000 64194	中科创达	2023 年 2 月 27 日	488,696.00	5,200	14	3.40	646.10	-	-
华泰证券	20230228000 26504	中科创达	2023 年 2 月 28 日	95,600.00	1,000	14	3.40	126.42	-	-
华泰证券	20230228000 26512	中科创达	2023 年 2 月 28 日	172,080.00	1,800	14	3.40	227.50	-	-
华泰证券	20230302000 11873	中科创达	2023 年 3 月 2 日	1,795,080.00	16,800	14	3.40	2,373.56	-	-
华泰证券	20230313000 61198	中科创达	2023 年 3 月 13 日	5,165,500.00	50,000	14	3.20	6,428.24	-	-
华泰证券	20230313000 63058	中科创达	2023 年 3 月 13 日	537,212.00	5,200	14	3.40	710.36	-	-
华泰证券	20230314000 19562	中科创达	2023 年 3 月 14 日	187,128.00	1,800	14	3.40	247.38	-	-
华泰证券	20230314000 19674	中科创达	2023 年 3 月 14 日	103,960.00	1,000	14	3.40	137.48	-	-
华泰证券	20230316000 13414	中科创达	2023 年 3 月 16 日	1,736,280.00	16,800	14	3.40	2,295.72	-	-
华泰证券	20230327000 68047	中科创达	2023 年 3 月 27 日	584,220.00	5,200	14	3.40	772.52	-	-
华泰证券	20230327000 69939	中科创达	2023 年 3 月 27 日	5,617,500.00	50,000	14	3.20	6,990.62	-	-
华泰证券	20230328000 23919	中科创达	2023 年 3 月 28 日	193,698.00	1,800	14	3.40	256.06	-	-
华泰证券	20230328000 23921	中科创达	2023 年 3 月 28 日	107,610.00	1,000	14	3.40	142.24	-	-
华泰证券	20230330000	中科创达	2023 年 3 月	1,810,704.00	16,800	14	3.40	2,394.14	-	-

	17435		30 日							
华泰证券	20230410000 59329	中科创达	2023 年 4 月 10 日	584,480.00	5,200	14	3.40	772.80	-	-
华泰证券	20230410000 61839	中科创达	2023 年 4 月 10 日	5,620,000.00	50,000	14	3.20	6,993.84	-	-
华泰证券	20230411000 17714	中科创达	2023 年 4 月 11 日	199,944.00	1,800	14	3.40	264.32	-	-
华泰证券	20230411000 17716	中科创达	2023 年 4 月 11 日	111,080.00	1,000	14	3.40	146.86	-	-
华泰证券	20230425000 66181	中科创达	2023 年 4 月 25 日	152,964.00	1,800	14	3.40	202.30	-	-
华泰证券	20230509000 14947	中科创达	2023 年 5 月 9 日	153,072.00	1,800	14	3.40	202.44	-	-
华泰证券	20230523000 07894	中科创达	2023 年 5 月 23 日	151,506.00	1,800	14	3.40	200.34	-	-
华泰证券	20230606000 15118	中科创达	2023 年 6 月 6 日	169,434.00	1,800	14	3.40	224.00	-	-
华泰证券	20230511000 01782	中科曙光	2023 年 5 月 11 日	2,317,500.00	50,000	14	3.20	2,884.00	-	-
华泰证券	20230515000 01561	中科曙光	2023 年 5 月 15 日	5,877,522.00	127,800	14	3.50	8,000.02	-	-
华泰证券	20230517000 01739	中科曙光	2023 年 5 月 17 日	1,362,900.00	30,000	14	3.50	1,855.00	-	-
华泰证券	20230518000 01292	中科曙光	2023 年 5 月 18 日	483,400.00	10,000	14	3.40	639.10	-	-
华泰证券	20230525000 02828	中科曙光	2023 年 5 月 25 日	1,246,080.00	26,400	14	3.50	1,696.10	-	-
华泰证券	20230525000 07424	中科曙光	2023 年 5 月 25 日	2,360,000.00	50,000	14	3.20	2,936.92	-	-
华泰证券	20230529000 01443	中科曙光	2023 年 5 月 29 日	105,189.00	2,100	14	3.20	130.90	-	-
华泰证券	20230529000 11157	中科曙光	2023 年 5 月 29 日	6,401,502.00	127,800	14	3.50	8,713.18	-	-
华泰证券	20230531000 01663	中科曙光	2023 年 5 月 31 日	374,500.00	7,000	14	3.50	509.74	-	-
华泰证券	20230531000 07917	中科曙光	2023 年 5 月 31 日	1,605,000.00	30,000	14	3.50	2,184.56	-	-
华泰证券	20230601000 24408	中科曙光	2023 年 6 月 1 日	526,900.00	10,000	14	3.40	696.64	-	-
华泰证券	20230602000 01094	中科曙光	2023 年 6 月 2 日	1,167,940.00	23,000	14	3.20	1,453.48	-	-
华泰证券	20230605000 01048	中科曙光	2023 年 6 月 5 日	517,600.00	10,000	14	3.20	644.14	-	-

华泰证券	20230608000 21090	中科曙光	2023 年 6 月 8 日	2,491,000.00	50,000	14	3.20	3,985.56	-	-
华泰证券	20230608000 23174	中科曙光	2023 年 6 月 8 日	1,315,248.00	26,400	14	3.50	2,301.66	-	-
华泰证券	20230612000 22982	中科曙光	2023 年 6 月 12 日	51,200.00	1,000	14	3.20	63.70	-	-
华泰证券	20230612000 40552	中科曙光	2023 年 6 月 12 日	6,543,360.00	127,800	14	3.50	8,906.24	-	-
华泰证券	20230612000 42138	中科曙光	2023 年 6 月 12 日	107,520.00	2,100	14	3.20	133.84	-	-
华泰证券	20230614000 51169	中科曙光	2023 年 6 月 14 日	387,870.00	7,000	14	3.50	527.94	-	-
华泰证券	20230614000 52109	中科曙光	2023 年 6 月 14 日	1,662,300.00	30,000	14	3.50	2,262.54	-	-
华泰证券	20230615000 28725	中科曙光	2023 年 6 月 15 日	539,100.00	10,000	14	3.40	712.88	-	-
华泰证券	20230616000 21841	中科曙光	2023 年 6 月 16 日	1,282,940.00	23,000	14	3.20	1,596.56	-	-
华泰证券	20230619000 17970	中科曙光	2023 年 6 月 19 日	611,200.00	10,000	14	3.20	597.63	509,000.00	597.63
华泰证券	20230626000 39454	中科曙光	2023 年 6 月 26 日	49,190.00	1,000	14	3.20	17.48	50,900.00	17.48
华泰证券	20230626000 42003	中科曙光	2023 年 6 月 26 日	103,299.00	2,100	14	3.20	36.72	106,890.00	36.72
华泰证券	20230626000 44892	中科曙光	2023 年 6 月 26 日	6,286,482.00	127,800	14	3.50	2,444.76	6,505,020.00	2,444.76
华泰证券	20230626000 47491	中科曙光	2023 年 6 月 26 日	2,459,500.00	50,000	14	3.20	874.48	2,545,000.00	874.48
华泰证券	20230626000 50304	中科曙光	2023 年 6 月 26 日	1,298,616.00	26,400	14	3.50	505.00	1,343,760.00	505.00
华泰证券	20230627000 04553	中科曙光	2023 年 6 月 27 日	132,921.00	2,700	14	3.20	35.46	137,430.00	35.46
华泰证券	20230628000 47224	中科曙光	2023 年 6 月 28 日	334,600.00	7,000	14	3.50	65.06	356,300.00	65.06
华泰证券	20230628000 54520	中科曙光	2023 年 6 月 28 日	1,434,000.00	30,000	14	3.50	278.84	1,527,000.00	278.84
华泰证券	20230629000 41486	中科曙光	2023 年 6 月 29 日	497,400.00	10,000	14	3.40	46.98	509,000.00	46.98
华泰证券	20230630000 16071	中科曙光	2023 年 6 月 30 日	1,170,700.00	23,000	14	3.20	-	1,170,700.00	-
华泰证券	20230530000 16210	中煤能源	2023 年 5 月 30 日	114,210.00	13,500	7	1.80	39.97	-	-
华泰证券	20230529000	中煤能源	2023 年 5 月	1,766,050.00	209,000	14	1.80	1,236.20	-	-

	01289		29 日							
华泰证券	20230529000 01370	中煤能源	2023 年 5 月 29 日	177,450.00	21,000	14	1.80	124.18	-	-
华泰证券	20230606000 17883	中煤能源	2023 年 6 月 6 日	114,750.00	13,500	7	1.80	40.18	-	-
华泰证券	20230613000 21882	中煤能源	2023 年 6 月 13 日	112,995.00	13,500	7	1.80	39.55	-	-
华泰证券	20230612000 22884	中煤能源	2023 年 6 月 12 日	1,782,770.00	209,000	14	1.80	1,247.96	-	-
华泰证券	20230620000 10296	中煤能源	2023 年 6 月 20 日	110,430.00	13,500	7	1.80	38.64	-	-
华泰证券	20230627000 21435	中煤能源	2023 年 6 月 27 日	109,890.00	13,500	7	1.80	16.47	113,940.00	16.47
华泰证券	20230626000 31563	中煤能源	2023 年 6 月 26 日	1,663,640.00	209,000	14	1.80	332.72	1,763,960.00	332.72
华泰证券	20230109000 37592	中伟股份	2023 年 1 月 9 日	1,755,250.00	25,000	14	3.40	3,481.17	-	-
华泰证券	20230112000 12811	中伟股份	2023 年 1 月 12 日	7,277,490.00	99,000	14	3.40	12,371.76	-	-
华泰证券	20230130000 70735	中伟股份	2023 年 1 月 30 日	7,657,650.00	99,000	14	3.40	10,125.08	-	-
华泰证券	20230130000 72129	中伟股份	2023 年 1 月 30 日	1,933,750.00	25,000	14	3.40	2,556.82	-	-
华泰证券	20230213000 82916	中伟股份	2023 年 2 月 13 日	1,867,500.00	25,000	14	3.40	2,469.32	-	-
华泰证券	20230223000 00575	中伟股份	2023 年 2 月 23 日	352,500.00	5,000	14	3.40	466.06	-	-
华泰证券	20230227000 74250	中伟股份	2023 年 2 月 27 日	1,730,500.00	25,000	14	3.40	2,288.16	-	-
华泰证券	20230309000 06502	中伟股份	2023 年 3 月 9 日	347,750.00	5,000	14	3.40	459.76	-	-
华泰证券	20230313000 68986	中伟股份	2023 年 3 月 13 日	1,779,000.00	25,000	14	3.40	2,352.28	-	-
华泰证券	20230323000 07018	中伟股份	2023 年 3 月 23 日	351,500.00	5,000	14	3.40	464.80	-	-
华泰证券	20230327000 69933	中伟股份	2023 年 3 月 27 日	1,817,500.00	25,000	14	3.40	2,403.10	-	-
华泰证券	20230406000 13008	中伟股份	2023 年 4 月 6 日	330,250.00	5,000	14	3.40	436.66	-	-
华泰证券	20230420000 12545	中伟股份	2023 年 4 月 20 日	324,750.00	5,000	14	3.40	429.38	-	-
华泰证券	20230504000 31769	中伟股份	2023 年 5 月 4 日	309,550.00	5,000	14	3.40	409.36	-	-

华泰证券	20230518000 39214	中伟股份	2023 年 5 月 18 日	306,600.00	5,000	14	3.40	405.44	-	-
华泰证券	20230601000 22357	中伟股份	2023 年 6 月 1 日	312,750.00	5,000	14	3.40	413.56	-	-
华泰证券	20230615000 36655	中伟股份	2023 年 6 月 15 日	312,000.00	5,000	14	3.40	412.58	-	-
华泰证券	20230629000 41690	中伟股份	2023 年 6 月 29 日	294,100.00	5,000	14	3.40	27.78	301,250.00	27.78
华泰证券	20230223000 00545	中芯国际	2023 年 2 月 23 日	210,800.00	5,000	14	3.40	278.74	-	-
华泰证券	20230309000 06492	中芯国际	2023 年 3 月 9 日	216,350.00	5,000	14	3.40	286.02	-	-
华泰证券	20230323000 06980	中芯国际	2023 年 3 月 23 日	261,600.00	5,000	14	3.40	345.94	-	-
华泰证券	20230406000 13760	中芯国际	2023 年 4 月 6 日	295,350.00	5,000	14	3.40	390.46	-	-
华泰证券	20230420000 05383	中芯国际	2023 年 4 月 20 日	332,400.00	5,000	14	3.40	439.46	-	-
华泰证券	20230504000 27271	中芯国际	2023 年 5 月 4 日	293,800.00	5,000	14	3.40	388.50	-	-
华泰证券	20230518000 40236	中芯国际	2023 年 5 月 18 日	275,500.00	5,000	14	3.40	364.28	-	-
华泰证券	20230601000 29115	中芯国际	2023 年 6 月 1 日	272,100.00	5,000	14	3.40	359.80	-	-
华泰证券	20230615000 32249	中芯国际	2023 年 6 月 15 日	273,900.00	5,000	14	3.40	362.18	-	-
华泰证券	20230629000 42388	中芯国际	2023 年 6 月 29 日	255,000.00	5,000	14	3.40	24.08	252,600.00	24.08
华泰证券	20230530000 16166	中信特钢	2023 年 5 月 30 日	271,264.00	17,300	7	1.80	94.92	-	-
华泰证券	20230529000 01258	中信特钢	2023 年 5 月 29 日	219,380.00	14,000	14	1.80	153.58	-	-
华泰证券	20230529000 01369	中信特钢	2023 年 5 月 29 日	658,140.00	42,000	14	1.80	460.74	-	-
华泰证券	20230606000 15748	中信特钢	2023 年 6 月 6 日	268,150.00	17,300	7	1.80	93.87	-	-
华泰证券	20230613000 21205	中信特钢	2023 年 6 月 13 日	268,842.00	17,300	7	1.80	94.08	-	-
华泰证券	20230612000 22449	中信特钢	2023 年 6 月 12 日	653,100.00	42,000	14	1.80	457.24	-	-
华泰证券	20230620000 10246	中信特钢	2023 年 6 月 20 日	262,268.00	17,300	7	1.80	91.77	-	-
华泰证券	20230627000	中信特钢	2023 年 6 月	269,880.00	17,300	7	1.80	40.47	274,032.00	40.47

	20221		27 日							
华泰证券	20230626000 44783	中信特钢	2023 年 6 月 26 日	627,480.00	42,000	14	1.80	125.48	665,280.00	125.48
华泰证券	20230523000 03216	中信银行	2023 年 5 月 23 日	579,825.00	85,900	14	3.20	721.56	-	-
华泰证券	20230530000 16197	中信银行	2023 年 5 月 30 日	88,560.00	13,500	7	1.80	31.01	-	-
华泰证券	20230529000 01284	中信银行	2023 年 5 月 29 日	1,588,190.00	241,000	14	1.80	1,111.74	-	-
华泰证券	20230529000 01388	中信银行	2023 年 5 月 29 日	530,495.00	80,500	14	1.80	371.42	-	-
华泰证券	20230606000 14674	中信银行	2023 年 6 月 6 日	89,910.00	13,500	7	1.80	31.50	-	-
华泰证券	20230613000 20595	中信银行	2023 年 6 月 13 日	84,375.00	13,500	7	1.80	29.54	-	-
华泰证券	20230612000 22838	中信银行	2023 年 6 月 12 日	1,530,350.00	241,000	14	1.80	1,071.28	-	-
华泰证券	20230620000 10276	中信银行	2023 年 6 月 20 日	81,405.00	13,500	7	1.80	28.49	-	-
华泰证券	20230627000 21960	中信银行	2023 年 6 月 27 日	80,460.00	13,500	7	1.80	12.06	80,730.00	12.06
华泰证券	20230626000 51175	中信银行	2023 年 6 月 26 日	1,429,130.00	241,000	14	1.80	285.84	1,441,180.00	285.84
华泰证券	20230605000 01034	中兴通讯	2023 年 6 月 5 日	36,050,000.00	1,000,000	14	3.20	44,862.16	-	-
华泰证券	20230619000 19146	中兴通讯	2023 年 6 月 19 日	39,680,000.00	1,000,000	14	3.20	38,798.21	45,540,000.00	38,798.21
华泰证券	20230612000 22681	中油资本	2023 年 6 月 12 日	3,660,000.00	500,000	14	3.20	4,554.62	-	-
华泰证券	20230613000 02599	中油资本	2023 年 6 月 13 日	1,480,000.00	200,000	14	3.20	1,841.84	-	-
华泰证券	20230614000 16372	中油资本	2023 年 6 月 14 日	744,000.00	100,000	14	3.20	925.82	-	-
华泰证券	20230615000 03676	中油资本	2023 年 6 月 15 日	3,755,000.00	500,000	14	3.20	4,672.92	-	-
华泰证券	20230619000 01078	中油资本	2023 年 6 月 19 日	1,177,500.00	150,000	14	3.20	1,151.37	1,084,500.00	1,151.37
华泰证券	20230620000 10298	中油资本	2023 年 6 月 20 日	76,100.00	10,000	14	3.20	67.60	72,300.00	67.60
华泰证券	20230626000 42075	中油资本	2023 年 6 月 26 日	3,510,000.00	500,000	14	3.20	1,248.00	3,615,000.00	1,248.00
华泰证券	20230627000 04527	中油资本	2023 年 6 月 27 日	237,729.00	32,700	14	3.20	63.39	236,421.00	63.39

华泰证券	20230627000 21404	中油资本	2023 年 6 月 27 日	1,454,000.00	200,000	14	3.20	387.72	1,446,000.00	387.72
华泰证券	20230628000 04404	中油资本	2023 年 6 月 28 日	627,932.00	87,700	14	3.20	111.64	634,071.00	111.64
华泰证券	20230628000 38702	中油资本	2023 年 6 月 28 日	716,000.00	100,000	14	3.20	127.28	723,000.00	127.28
华泰证券	20230629000 44184	中油资本	2023 年 6 月 29 日	3,580,000.00	500,000	14	3.20	318.22	3,615,000.00	318.22
华泰证券	20230113000 08438	卓胜微	2023 年 1 月 13 日	249,700.00	2,000	14	3.40	400.86	-	-
华泰证券	20230130000 84281	卓胜微	2023 年 1 月 30 日	282,700.00	2,000	14	3.40	373.80	-	-
华泰证券	20230213000 63624	卓胜微	2023 年 2 月 13 日	263,260.00	2,000	14	3.40	348.04	-	-
华泰证券	20230215000 00838	卓胜微	2023 年 2 月 15 日	1,315,400.00	10,000	14	3.40	1,739.22	-	-
华泰证券	20230217000 00980	卓胜微	2023 年 2 月 17 日	3,666,000.00	30,000	14	3.40	4,847.22	-	-
华泰证券	20230220000 00789	卓胜微	2023 年 2 月 20 日	3,306,200.00	27,100	14	3.40	4,371.50	-	-
华泰证券	20230222000 00539	卓胜微	2023 年 2 月 22 日	896,175.00	7,500	14	3.40	1,184.96	-	-
华泰证券	20230227000 69674	卓胜微	2023 年 2 月 27 日	234,900.00	2,000	14	3.40	310.66	-	-
华泰证券	20230301000 15853	卓胜微	2023 年 3 月 1 日	1,183,200.00	10,000	14	3.40	1,564.50	-	-
华泰证券	20230303000 09943	卓胜微	2023 年 3 月 3 日	3,630,600.00	30,000	14	3.40	4,800.46	-	-
华泰证券	20230306000 16955	卓胜微	2023 年 3 月 6 日	3,221,648.00	27,100	14	3.40	4,259.78	-	-
华泰证券	20230313000 68908	卓胜微	2023 年 3 月 13 日	234,400.00	2,000	14	3.40	309.96	-	-
华泰证券	20230315000 15733	卓胜微	2023 年 3 月 15 日	1,281,400.00	10,000	14	3.40	1,694.28	-	-
华泰证券	20230317000 09693	卓胜微	2023 年 3 月 17 日	3,735,000.00	30,000	14	3.40	4,938.50	-	-
华泰证券	20230320000 09174	卓胜微	2023 年 3 月 20 日	3,422,188.00	27,100	14	3.40	4,524.94	-	-
华泰证券	20230327000 69607	卓胜微	2023 年 3 月 27 日	243,000.00	2,000	14	3.40	321.30	-	-
华泰证券	20230329000 16864	卓胜微	2023 年 3 月 29 日	1,217,600.00	10,000	14	3.40	1,610.00	-	-
华泰证券	20230331000	卓胜微	2023 年 3 月	3,732,000.00	30,000	14	3.40	4,934.58	-	-

	08775		31 日							
华泰证券	20230403000 18237	卓胜微	2023 年 4 月 3 日	3,531,130.00	27,100	14	3.40	4,669.00	-	-
华泰证券	20230410000 64951	卓胜微	2023 年 4 月 10 日	262,920.00	2,000	14	3.40	347.62	-	-
华泰证券	20230412000 31198	卓胜微	2023 年 4 月 12 日	1,308,000.00	10,000	14	3.40	1,729.42	-	-
华泰证券	20230414000 08161	卓胜微	2023 年 4 月 14 日	3,957,300.00	30,000	14	3.40	5,232.50	-	-
华泰证券	20230417000 08192	卓胜微	2023 年 4 月 17 日	3,490,480.00	27,100	14	3.40	5,604.22	-	-
华泰证券	20230424000 38665	卓胜微	2023 年 4 月 24 日	212,120.00	2,000	14	3.40	280.42	-	-
华泰证券	20230426000 31904	卓胜微	2023 年 4 月 26 日	1,001,400.00	10,000	14	3.40	1,324.12	-	-
华泰证券	20230428000 12962	卓胜微	2023 年 4 月 28 日	3,045,900.00	30,000	14	3.40	4,027.38	-	-
华泰证券	20230504000 31773	卓胜微	2023 年 5 月 4 日	2,635,475.00	27,100	14	3.40	3,484.74	-	-
华泰证券	20230508000 24839	卓胜微	2023 年 5 月 8 日	198,360.00	2,000	14	3.40	262.22	-	-
华泰证券	20230510000 31238	卓胜微	2023 年 5 月 10 日	979,900.00	10,000	14	3.40	1,295.70	-	-
华泰证券	20230524000 17258	卓胜微	2023 年 5 月 24 日	925,000.00	10,000	14	3.40	1,223.04	-	-
华泰证券	20230607000 24669	卓胜微	2023 年 6 月 7 日	1,038,700.00	10,000	14	3.40	1,373.40	-	-
华泰证券	20230621000 15702	卓胜微	2023 年 6 月 21 日	969,000.00	10,000	14	3.40	823.68	966,300.00	823.68
华泰证券	20230612000 22682	紫光股份	2023 年 6 月 12 日	81,775.00	2,500	14	3.20	101.78	-	-
华泰证券	20230613000 02607	紫光股份	2023 年 6 月 13 日	554,440.00	16,600	14	3.20	689.92	-	-
华泰证券	20230626000 42496	紫光股份	2023 年 6 月 26 日	87,550.00	2,500	14	3.20	31.12	79,625.00	31.12
华泰证券	20230627000 18063	紫光股份	2023 年 6 月 27 日	580,004.00	16,600	14	3.20	154.68	528,710.00	154.68
华泰证券	20230515000 01539	紫光国微	2023 年 5 月 15 日	5,651,860.00	61,300	14	3.20	7,033.46	-	-
华泰证券	20230627000 04533	紫光国微	2023 年 6 月 27 日	295,845.00	3,300	14	3.20	78.90	307,725.00	78.90
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
华泰证券	20220104000 00462	泰格医药	2022年1月4 日	11,854,000.00	100,000	14	3.40	15,673.62	-	-
华泰证券	20220104000 23069	欧普康视	2022年1月4 日	1,405,250.00	25,000	14	3.40	1,858.05	-	-
华泰证券	20220104000 23081	沃森生物	2022年1月4 日	616,896.00	11,200	14	3.40	815.67	-	-
华泰证券	20220104000 23091	中微公司	2022年1月4 日	2,402,200.00	20,000	14	3.40	3,176.24	-	-
华泰证券	20220104000 23095	温氏股份	2022年1月4 日	4,888,752.00	236,400	14	3.40	6,464.02	-	-
华泰证券	20220104000 23097	东方财富	2022年1月4 日	8,229,870.00	229,500	14	3.40	10,881.72	-	-
华泰证券	20220104000 23107	英科医疗	2022年1月4 日	219,830.00	3,800	14	3.40	290.66	-	-
华泰证券	20220104000 23111	中微公司	2022年1月4 日	3,831,509.00	31,900	14	3.40	5,066.11	-	-
华泰证券	20220104000 23117	蓝思科技	2022年1月4 日	1,239,744.00	52,800	14	3.40	1,639.22	-	-
华泰证券	20220105000 00791	安克创新	2022年1月5 日	968,060.00	9,700	14	3.40	1,279.99	-	-
华泰证券	20220105000 00793	华大基因	2022年1月5 日	1,298,848.00	14,800	14	3.40	1,717.37	-	-
华泰证券	20220105000 00797	华熙生物	2022年1月5 日	1,480,000.00	10,000	14	3.40	1,956.89	-	-
华泰证券	20220105000 09047	英科医疗	2022年1月5 日	113,460.00	2,000	14	3.40	150.02	-	-
华泰证券	20220105000 09049	智飞生物	2022年1月5 日	2,467,712.00	20,800	14	3.40	3,262.86	-	-
华泰证券	20220105000 09051	智飞生物	2022年1月5 日	3,630,384.00	30,600	14	3.40	4,800.17	-	-
华泰证券	20220105000 09053	英科医疗	2022年1月5 日	561,627.00	9,900	14	3.40	742.60	-	-
华泰证券	20220105000 09055	阳光电源	2022年1月5 日	1,083,600.00	8,400	14	3.40	1,432.76	-	-
华泰证券	20220105000 09059	同花顺	2022年1月5 日	2,802,604.00	19,600	14	3.40	3,705.67	-	-
华泰证券	20220106000 00607	华大基因	2022年1月6 日	355,600.00	4,000	14	3.40	470.18	-	-
华泰证券	20220106000 00608	金龙鱼	2022年1月6 日	9,475,752.00	145,200	14	3.40	12,529.05	-	-

华泰证券	2022010600010077	华大基因	2022 年 1 月 6 日	1,644,650.00	18,500	14	3.40	2,174.59	-	-
华泰证券	2022010600010085	沃森生物	2022 年 1 月 6 日	1,562,896.00	27,400	14	3.40	2,066.50	-	-
华泰证券	2022010700000651	华大基因	2022 年 1 月 7 日	1,364,550.00	15,000	14	3.40	1,804.24	-	-
华泰证券	2022010700000654	中微公司	2022 年 1 月 7 日	3,621,000.00	30,000	14	3.40	4,787.77	-	-
华泰证券	20220107000009903	华大基因	2022 年 1 月 7 日	136,455.00	1,500	14	3.40	180.42	-	-
华泰证券	20220107000010145	金龙鱼	2022 年 1 月 7 日	1,107,119.00	16,900	14	3.40	1,463.86	-	-
华泰证券	20220110000001142	金龙鱼	2022 年 1 月 10 日	65,340.00	1,000	14	3.40	86.39	-	-
华泰证券	20220110000001144	健帆生物	2022 年 1 月 10 日	929,900.00	17,000	14	3.40	1,229.53	-	-
华泰证券	20220110000001146	宋城演艺	2022 年 1 月 10 日	288,028.00	19,100	14	3.40	380.84	-	-
华泰证券	20220110000011417	亿纬锂能	2022 年 1 月 10 日	1,451,800.00	14,000	14	3.40	1,919.60	-	-
华泰证券	20220110000011421	东方财富	2022 年 1 月 10 日	10,059,000.00	300,000	14	3.40	13,300.23	-	-
华泰证券	20220110000011425	金龙鱼	2022 年 1 月 10 日	1,385,208.00	21,200	14	3.40	1,831.55	-	-
华泰证券	20220110000011431	宋城演艺	2022 年 1 月 10 日	431,288.00	28,600	14	3.40	570.26	-	-
华泰证券	20220111000001250	汇川技术	2022 年 1 月 11 日	6,520,000.00	100,000	14	3.40	8,620.89	-	-
华泰证券	20220111000011737	华大基因	2022 年 1 月 11 日	1,412,100.00	15,000	14	3.40	1,867.11	-	-
华泰证券	20220111000011739	英科医疗	2022 年 1 月 11 日	105,111.00	1,700	14	3.40	138.98	-	-
华泰证券	20220111000013271	东方财富	2022 年 1 月 11 日	10,020,000.00	300,000	14	3.40	13,248.67	-	-
华泰证券	20220111000013273	华大基因	2022 年 1 月 11 日	1,044,954.00	11,100	14	3.40	1,381.66	-	-
华泰证券	20220111000013275	华大基因	2022 年 1 月 11 日	677,808.00	7,200	14	3.40	896.21	-	-
华泰证券	20220112000000558	阳光电源	2022 年 1 月 12 日	2,384,310.00	19,000	14	3.40	3,152.59	-	-
华泰证券	20220112000000560	金山办公	2022 年 1 月 12 日	7,816,500.00	30,000	14	3.40	10,335.15	-	-
华泰证券	202201120000	华大基因	2022 年 1 月	478,550.00	5,000	14	3.40	632.75	-	-

	16601		12 日							
华泰证券	20220112000 16865	健帆生物	2022 年 1 月 12 日	654,489.00	12,100	14	3.40	865.38	-	-
华泰证券	20220112000 16999	华大基因	2022 年 1 月 12 日	497,692.00	5,200	14	3.40	658.06	-	-
华泰证券	20220112000 17003	沪硅产业	2022 年 1 月 12 日	5,280,000.00	200,000	14	3.40	6,981.33	-	-
华泰证券	20220113000 00678	蓝思科技	2022 年 1 月 13 日	4,364,619.00	214,900	14	3.40	5,771.00	-	-
华泰证券	20220113000 00679	英科医疗	2022 年 1 月 13 日	378,900.00	6,000	14	3.40	500.99	-	-
华泰证券	20220113000 00690	金山办公	2022 年 1 月 13 日	5,080,200.00	20,000	14	3.60	7,112.28	-	-
华泰证券	20220113000 10154	沪硅产业	2022 年 1 月 13 日	656,500.00	25,000	14	3.40	868.04	-	-
华泰证券	20220113000 12276	爱尔眼科	2022 年 1 月 13 日	83,007.00	2,300	14	3.40	109.75	-	-
华泰证券	20220114000 00575	智飞生物	2022 年 1 月 14 日	192,508.00	1,700	14	3.40	254.54	-	-
华泰证券	20220114000 20420	爱尔眼科	2022 年 1 月 14 日	322,595.00	9,100	14	3.40	426.54	-	-
华泰证券	20220114000 24078	华大基因	2022 年 1 月 14 日	404,720.00	4,000	14	3.40	535.13	-	-
华泰证券	20220114000 24080	沃森生物	2022 年 1 月 14 日	1,007,600.00	17,600	14	3.40	1,332.27	-	-
华泰证券	20220114000 24102	智飞生物	2022 年 1 月 14 日	113,240.00	1,000	14	3.40	149.73	-	-
华泰证券	20220104000 23075	英科医疗	2022 年 1 月 4 日	578,500.00	10,000	28	3.40	1,857.63	-	-
华泰证券	20220104000 23115	芒果超媒	2022 年 1 月 4 日	4,003,063.00	68,300	28	3.40	12,854.28	-	-
华泰证券	20220104000 23119	芒果超媒	2022 年 1 月 4 日	498,185.00	8,500	28	3.40	1,599.73	-	-
华泰证券	20220105000 09057	温氏股份	2022 年 1 月 5 日	1,244,745.00	59,700	28	3.40	3,879.46	-	-
华泰证券	20220106000 10081	芒果超媒	2022 年 1 月 6 日	1,701,792.00	31,100	28	3.40	5,143.19	-	-
华泰证券	20220107000 09907	澜起科技	2022 年 1 月 7 日	3,894,768.00	51,600	28	3.40	11,403.02	-	-
华泰证券	20220110000 11429	华大基因	2022 年 1 月 10 日	313,269.00	3,300	28	3.40	828.42	-	-
华泰证券	20220118000 00726	健帆生物	2022 年 1 月 18 日	1,665,000.00	30,000	14	3.40	3,145.00	-	-

华泰证券	20220118000 00728	先导智能	2022 年 1 月 18 日	133,740.00	1,800	14	3.40	252.62	-	-
华泰证券	20220118000 23946	温氏股份	2022 年 1 月 18 日	4,645,260.00	236,400	14	3.40	8,774.38	-	-
华泰证券	20220118000 23950	欧普康视	2022 年 1 月 18 日	1,228,250.00	25,000	14	3.40	2,320.03	-	-
华泰证券	20220118000 23954	中微公司	2022 年 1 月 18 日	2,367,400.00	20,000	14	3.40	4,471.76	-	-
华泰证券	20220118000 23962	沃森生物	2022 年 1 月 18 日	619,472.00	11,200	14	3.40	1,170.11	-	-
华泰证券	20220118000 23968	中微公司	2022 年 1 月 18 日	3,776,003.00	31,900	14	3.40	7,132.45	-	-
华泰证券	20220118000 23974	东方财富	2022 年 1 月 18 日	7,591,860.00	229,500	14	3.40	14,340.18	-	-
华泰证券	20220118000 23976	泰格医药	2022 年 1 月 18 日	12,202,000.00	100,000	14	3.40	23,048.22	-	-
华泰证券	20220118000 23982	英科医疗	2022 年 1 月 18 日	242,630.00	3,800	14	3.40	458.30	-	-
华泰证券	20220119000 00656	汇川技术	2022 年 1 月 19 日	6,619,800.00	100,300	14	3.40	11,878.86	-	-
华泰证券	20220119000 00658	智飞生物	2022 年 1 月 19 日	3,882,870.00	36,500	14	3.40	6,967.59	-	-
华泰证券	20220119000 09857	英科医疗	2022 年 1 月 19 日	630,927.00	9,900	14	3.40	1,132.16	-	-
华泰证券	20220119000 09859	安克创新	2022 年 1 月 19 日	908,696.00	9,700	14	3.40	1,630.60	-	-
华泰证券	20220119000 09861	华大基因	2022 年 1 月 19 日	1,364,708.00	14,800	14	3.40	2,448.89	-	-
华泰证券	20220119000 09863	英科医疗	2022 年 1 月 19 日	127,460.00	2,000	14	3.40	228.72	-	-
华泰证券	20220119000 09865	华熙生物	2022 年 1 月 19 日	1,334,800.00	10,000	14	3.40	2,395.22	-	-
华泰证券	20220119000 09867	智飞生物	2022 年 1 月 19 日	3,255,228.00	30,600	14	3.40	5,841.33	-	-
华泰证券	20220119000 09869	阳光电源	2022 年 1 月 19 日	1,013,964.00	8,400	14	3.40	1,819.50	-	-
华泰证券	20220119000 10333	智飞生物	2022 年 1 月 19 日	2,212,704.00	20,800	14	3.40	3,970.57	-	-
华泰证券	20220120000 00805	康龙化成	2022 年 1 月 20 日	5,755,950.00	45,000	14	3.40	9,785.12	-	-
华泰证券	20220120000 08878	华大基因	2022 年 1 月 20 日	1,675,175.00	18,500	14	3.40	2,847.80	-	-
华泰证券	20220120000	沃森生物	2022 年 1 月	1,477,682.00	27,400	14	3.40	2,512.06	-	-

	09666		20 日							
华泰证券	20220120000 09668	华大基因	2022 年 1 月 20 日	362,200.00	4,000	14	3.40	615.74	-	-
华泰证券	20220121000 11150	华大基因	2022 年 1 月 21 日	1,335,000.00	15,000	14	3.40	2,143.42	-	-
华泰证券	20220121000 11242	中微公司	2022 年 1 月 21 日	3,394,500.00	30,000	14	3.40	5,450.06	-	-
华泰证券	20220121000 11244	华大基因	2022 年 1 月 21 日	133,500.00	1,500	14	3.40	214.34	-	-
华泰证券	20220124000 00415	华大基因	2022 年 1 月 24 日	706,240.00	8,000	14	3.40	933.81	-	-
华泰证券	20220124000 09128	东方财富	2022 年 1 月 24 日	9,777,000.00	300,000	14	3.40	12,927.37	-	-
华泰证券	20220124000 09130	宋城演艺	2022 年 1 月 24 日	299,870.00	19,100	14	3.40	396.49	-	-
华泰证券	20220124000 09132	亿纬锂能	2022 年 1 月 24 日	1,399,860.00	14,000	14	3.40	1,850.93	-	-
华泰证券	20220124000 09216	金龙鱼	2022 年 1 月 24 日	1,294,048.00	21,200	14	3.40	1,711.02	-	-
华泰证券	20220124000 09218	宋城演艺	2022 年 1 月 24 日	449,020.00	28,600	14	3.40	593.70	-	-
华泰证券	20220124000 09220	健帆生物	2022 年 1 月 24 日	854,080.00	17,000	14	3.40	1,129.28	-	-
华泰证券	20220125000 00526	华大基因	2022 年 1 月 25 日	254,220.00	3,000	14	3.40	336.14	-	-
华泰证券	20220125000 00528	宋城演艺	2022 年 1 月 25 日	615,060.00	40,200	14	3.40	813.25	-	-
华泰证券	20220125000 00530	英科医疗	2022 年 1 月 25 日	56,000.00	1,000	14	3.40	74.04	-	-
华泰证券	20220125000 09194	汇川技术	2022 年 1 月 25 日	6,649,000.00	100,000	14	3.40	8,791.46	-	-
华泰证券	20220125000 09200	华大基因	2022 年 1 月 25 日	940,614.00	11,100	14	3.40	1,243.70	-	-
华泰证券	20220125000 11626	华大基因	2022 年 1 月 25 日	1,271,100.00	15,000	14	3.40	1,680.68	-	-
华泰证券	20220125000 11628	华大基因	2022 年 1 月 25 日	610,128.00	7,200	14	3.40	806.72	-	-
华泰证券	20220125000 11630	东方财富	2022 年 1 月 25 日	9,516,000.00	300,000	14	3.40	12,582.27	-	-
华泰证券	20220125000 11636	英科医疗	2022 年 1 月 25 日	95,200.00	1,700	14	3.40	125.88	-	-
华泰证券	20220126000 10786	阳光电源	2022 年 1 月 26 日	2,459,550.00	19,000	14	3.40	3,252.07	-	-

华泰证券	2022012600011942	华大基因	2022 年 1 月 26 日	422,500.00	5,000	14	3.40	558.64	-	-
华泰证券	2022012600011944	华大基因	2022 年 1 月 26 日	439,400.00	5,200	14	3.40	580.98	-	-
华泰证券	2022012600011948	沪硅产业	2022 年 1 月 26 日	5,196,000.00	200,000	14	3.40	6,870.27	-	-
华泰证券	2022012600011964	金山办公	2022 年 1 月 26 日	7,673,100.00	30,000	14	3.40	10,145.54	-	-
华泰证券	2022012600011970	健帆生物	2022 年 1 月 26 日	572,693.00	12,100	14	3.40	757.23	-	-
华泰证券	2022011300010162	东方财富	2022 年 1 月 13 日	16,645,601.00	511,700	28	3.40	44,018.37	-	-
华泰证券	2022012700000541	康龙化成	2022 年 1 月 27 日	10,422,405.00	86,100	14	3.40	13,780.74	-	-
华泰证券	2022012700000543	中国通号	2022 年 1 月 27 日	5,255,406.00	1,092,600	14	3.40	6,948.81	-	-
华泰证券	20220127000009925	金山办公	2022 年 1 月 27 日	4,937,400.00	20,000	14	3.60	6,912.36	-	-
华泰证券	20220127000009931	爱尔眼科	2022 年 1 月 27 日	74,129.00	2,300	14	3.40	98.02	-	-
华泰证券	20220127000009937	沪硅产业	2022 年 1 月 27 日	600,750.00	25,000	14	3.40	794.33	-	-
华泰证券	20220127000009945	英科医疗	2022 年 1 月 27 日	321,600.00	6,000	14	3.40	425.23	-	-
华泰证券	2022011400024520	东方财富	2022 年 1 月 14 日	3,222,000.00	100,000	28	3.40	8,520.40	-	-
华泰证券	2022012800000260	英科医疗	2022 年 1 月 28 日	523,314.00	9,900	14	3.40	691.94	-	-
华泰证券	2022012800018798	华大基因	2022 年 1 月 28 日	336,000.00	4,000	14	3.40	444.27	-	-
华泰证券	2022012800018812	爱尔眼科	2022 年 1 月 28 日	293,657.00	9,100	14	3.40	388.28	-	-
华泰证券	2022012800018824	智飞生物	2022 年 1 月 28 日	105,620.00	1,000	14	3.40	139.65	-	-
华泰证券	2022011700002563	阳光电源	2022 年 1 月 17 日	5,075,290.00	40,700	28	3.40	13,421.32	-	-
华泰证券	2022011700002793	汇川技术	2022 年 1 月 17 日	986,524.00	15,400	28	3.40	2,608.81	-	-
华泰证券	2022020700001159	宋城演艺	2022 年 2 月 7 日	123,574.00	8,200	14	3.40	163.39	-	-
华泰证券	20220207000043903	华熙生物	2022 年 2 月 7 日	1,200,100.00	10,000	14	3.40	1,586.80	-	-
华泰证券	202202070000	汇川技术	2022 年 2 月 7 日	6,042,072.00	100,300	14	3.40	7,988.96	-	-

	43921		日							
华泰证券	20220207000 43927	中微公司	2022年2月7 日	3,600,900.00	30,000	14	3.40	4,761.19	-	-
华泰证券	20220207000 43929	东方财富	2022年2月7 日	7,394,490.00	229,500	14	3.40	9,777.16	-	-
华泰证券	20220207000 43945	阳光电源	2022年2月7 日	948,276.00	8,400	14	3.40	1,253.83	-	-
华泰证券	20220207000 43951	智飞生物	2022年2月7 日	2,297,776.00	20,800	14	3.40	3,038.17	-	-
华泰证券	20220207000 43953	康龙化成	2022年2月7 日	5,453,100.00	45,000	14	3.40	7,210.21	-	-
华泰证券	20220207000 43955	智飞生物	2022年2月7 日	4,032,155.00	36,500	14	3.40	5,331.40	-	-
华泰证券	20220207000 43961	智飞生物	2022年2月7 日	3,380,382.00	30,600	14	3.40	4,469.62	-	-
华泰证券	20220207000 43977	华大基因	2022年2月7 日	1,294,350.00	15,000	14	3.40	1,711.42	-	-
华泰证券	20220207000 43979	华大基因	2022年2月7 日	1,277,092.00	14,800	14	3.40	1,688.60	-	-
华泰证券	20220207000 43981	华大基因	2022年2月7 日	1,596,365.00	18,500	14	3.40	2,110.75	-	-
华泰证券	20220207000 43983	华大基因	2022年2月7 日	129,435.00	1,500	14	3.40	171.14	-	-
华泰证券	20220207000 43985	华大基因	2022年2月7 日	345,160.00	4,000	14	3.40	456.38	-	-
华泰证券	20220207000 43987	沃森生物	2022年2月7 日	1,376,576.00	27,400	14	3.40	1,820.14	-	-
华泰证券	20220207000 44001	英科医疗	2022年2月7 日	202,046.00	3,800	14	3.40	267.15	-	-
华泰证券	20220207000 44005	英科医疗	2022年2月7 日	106,340.00	2,000	14	3.40	140.61	-	-
华泰证券	20220207000 46337	温氏股份	2022年2月7 日	4,881,660.00	236,400	14	3.40	6,454.64	-	-
华泰证券	20220207000 46355	华大基因	2022年2月7 日	690,320.00	8,000	14	3.40	912.76	-	-
华泰证券	20220207000 46359	亿纬锂能	2022年2月7 日	1,320,200.00	14,000	14	3.40	1,745.60	-	-
华泰证券	20220207000 46361	东方财富	2022年2月7 日	9,666,000.00	300,000	14	3.40	12,780.60	-	-
华泰证券	20220207000 46377	健帆生物	2022年2月7 日	788,460.00	17,000	14	3.40	1,042.52	-	-
华泰证券	20220207000 46381	金龙鱼	2022年2月7 日	1,216,244.00	21,200	14	3.40	1,608.14	-	-

华泰证券	2022020700046387	宋城演艺	2022 年 2 月 7 日	287,837.00	19,100	14	3.40	380.58	-	-
华泰证券	2022020700049251	沃森生物	2022 年 2 月 7 日	562,688.00	11,200	14	3.40	744.00	-	-
华泰证券	2022020700054829	泰格医药	2022 年 2 月 7 日	10,468,000.00	100,000	14	3.40	13,841.02	-	-
华泰证券	2022020700054863	欧普康视	2022 年 2 月 7 日	945,000.00	25,000	14	3.40	1,249.50	-	-
华泰证券	2022020700054867	健帆生物	2022 年 2 月 7 日	1,391,400.00	30,000	14	3.40	1,839.74	-	-
华泰证券	2022020700054887	安克创新	2022 年 2 月 7 日	931,782.00	9,700	14	3.40	1,232.02	-	-
华泰证券	2022020800001017	沪硅产业	2022 年 2 月 8 日	964,400.00	40,000	14	3.40	1,275.15	-	-
华泰证券	2022020800001021	康龙化成	2022 年 2 月 8 日	553,749.00	4,900	14	3.40	732.18	-	-
华泰证券	2022020800001023	先导智能	2022 年 2 月 8 日	84,344.00	1,300	14	3.40	111.52	-	-
华泰证券	2022020800001025	蓝思科技	2022 年 2 月 8 日	65,317.00	4,300	14	3.40	86.36	-	-
华泰证券	2022020800001027	宋城演艺	2022 年 2 月 8 日	170,130.00	10,700	14	3.40	224.95	-	-
华泰证券	20220208000015248	英科医疗	2022 年 2 月 8 日	92,242.00	1,700	14	3.40	121.96	-	-
华泰证券	20220208000015250	英科医疗	2022 年 2 月 8 日	54,260.00	1,000	14	3.40	71.74	-	-
华泰证券	20220208000015254	华大基因	2022 年 2 月 8 日	1,299,450.00	15,000	14	3.40	1,718.16	-	-
华泰证券	20220208000015258	宋城演艺	2022 年 2 月 8 日	639,180.00	40,200	14	3.40	845.14	-	-
华泰证券	20220208000015658	汇川技术	2022 年 2 月 8 日	5,970,000.00	100,000	14	3.40	7,893.67	-	-
华泰证券	20220208000015664	华大基因	2022 年 2 月 8 日	961,593.00	11,100	14	3.40	1,271.44	-	-
华泰证券	20220208000015666	华大基因	2022 年 2 月 8 日	623,736.00	7,200	14	3.40	824.72	-	-
华泰证券	20220208000015668	华大基因	2022 年 2 月 8 日	259,890.00	3,000	14	3.40	343.63	-	-
华泰证券	20220208000015672	东方财富	2022 年 2 月 8 日	9,639,000.00	300,000	14	3.40	12,744.90	-	-
华泰证券	20220209000000842	先导智能	2022 年 2 月 9 日	4,852,680.00	76,300	14	3.40	6,416.32	-	-
华泰证券	202202090000	健帆生物	2022 年 2 月 9 日	85,266.00	1,800	14	3.40	112.74	-	-

	00844		日							
华泰证券	2022020900000846	蓝思科技	2022 年 2 月 9 日	174,608.00	11,200	14	3.40	230.87	-	-
华泰证券	2022020900000848	泰格医药	2022 年 2 月 9 日	4,343,208.00	43,800	14	3.40	5,742.69	-	-
华泰证券	2022020900000849	宋城演艺	2022 年 2 月 9 日	1,025,010.00	63,000	14	3.40	1,355.29	-	-
华泰证券	2022020900016386	沪硅产业	2022 年 2 月 9 日	4,836,000.00	200,000	14	3.40	6,394.27	-	-
华泰证券	2022020900016390	阳光电源	2022 年 2 月 9 日	2,033,950.00	19,000	14	3.40	2,689.33	-	-
华泰证券	2022020900016394	华大基因	2022 年 2 月 9 日	450,580.00	5,200	14	3.40	595.77	-	-
华泰证券	2022020900016396	华大基因	2022 年 2 月 9 日	433,250.00	5,000	14	3.40	572.85	-	-
华泰证券	2022020900017372	金山办公	2022 年 2 月 9 日	6,867,000.00	30,000	14	3.40	9,079.70	-	-
华泰证券	2022012700009939	爱尔眼科	2022 年 1 月 27 日	1,998,260.00	62,000	28	3.40	5,284.29	-	-
华泰证券	2022021000000694	爱尔眼科	2022 年 2 月 10 日	100,770.00	3,000	14	3.40	133.24	-	-
华泰证券	2022021000013168	康龙化成	2022 年 2 月 10 日	9,364,236.00	86,100	14	3.40	12,381.60	-	-
华泰证券	2022021000013174	沪硅产业	2022 年 2 月 10 日	579,500.00	25,000	14	3.40	766.23	-	-
华泰证券	2022021000014024	金山办公	2022 年 2 月 10 日	4,277,600.00	20,000	14	3.60	5,988.64	-	-
华泰证券	2022012800018800	汇川技术	2022 年 1 月 28 日	1,265,789.00	21,100	28	3.40	3,347.31	-	-
华泰证券	2022012800018804	沃森生物	2022 年 1 月 28 日	7,466,180.00	154,900	28	3.40	19,743.90	-	-
华泰证券	2022012800018808	欧普康视	2022 年 1 月 28 日	1,861,236.00	49,200	28	3.40	4,921.94	-	-
华泰证券	2022021100018612	英科医疗	2022 年 2 月 11 日	506,484.00	9,900	14	3.40	669.68	-	-
华泰证券	2022021100018616	华大基因	2022 年 2 月 11 日	345,960.00	4,000	14	3.40	457.44	-	-
华泰证券	2022021100018618	爱尔眼科	2022 年 2 月 11 日	294,840.00	9,100	14	3.40	389.84	-	-
华泰证券	2022021400000399	英科医疗	2022 年 2 月 14 日	848,924.00	16,600	14	3.40	1,122.47	-	-
华泰证券	2022021600000439	英科医疗	2022 年 2 月 16 日	540,853.00	10,300	14	3.40	715.13	-	-

华泰证券	2022021700000373	金龙鱼	2022 年 2 月 17 日	57,590.00	1,000	14	3.40	76.15	-	-
华泰证券	2022020700043933	澜起科技	2022 年 2 月 7 日	3,713,136.00	51,600	28	3.40	9,819.18	-	-
华泰证券	2022020700043993	芒果超媒	2022 年 2 月 7 日	292,400.00	8,500	28	3.40	773.24	-	-
华泰证券	2022020700044003	英科医疗	2022 年 2 月 7 日	531,700.00	10,000	28	3.40	1,406.05	-	-
华泰证券	2022020700048421	华大基因	2022 年 2 月 7 日	284,757.00	3,300	28	3.40	753.02	-	-
华泰证券	2022022100035695	汇川技术	2022 年 2 月 21 日	6,449,290.00	100,300	14	3.40	8,527.39	-	-
华泰证券	2022022100035699	英科医疗	2022 年 2 月 21 日	105,960.00	2,000	14	3.40	140.10	-	-
华泰证券	2022022100035703	智飞生物	2022 年 2 月 21 日	3,843,666.00	30,600	14	3.40	5,082.18	-	-
华泰证券	2022022100035705	英科医疗	2022 年 2 月 21 日	201,324.00	3,800	14	3.40	266.20	-	-
华泰证券	2022022100035707	智飞生物	2022 年 2 月 21 日	4,584,765.00	36,500	14	3.40	6,062.08	-	-
华泰证券	2022022100035711	智飞生物	2022 年 2 月 21 日	2,612,688.00	20,800	14	3.40	3,454.55	-	-
华泰证券	2022022100035753	泰格医药	2022 年 2 月 21 日	9,995,000.00	100,000	14	3.40	13,215.61	-	-
华泰证券	2022022100035757	沃森生物	2022 年 2 月 21 日	1,373,562.00	27,400	14	3.40	1,816.15	-	-
华泰证券	2022022100035759	欧普康视	2022 年 2 月 21 日	1,008,750.00	25,000	14	3.40	1,333.79	-	-
华泰证券	2022022100035761	沃森生物	2022 年 2 月 21 日	561,456.00	11,200	14	3.40	742.37	-	-
华泰证券	2022022100037687	安克创新	2022 年 2 月 21 日	947,496.00	9,700	14	3.40	1,252.80	-	-
华泰证券	2022022100043357	宋城演艺	2022 年 2 月 21 日	303,690.00	19,100	14	3.40	401.55	-	-
华泰证券	2022022100043359	宋城演艺	2022 年 2 月 21 日	130,380.00	8,200	14	3.40	172.39	-	-
华泰证券	2022022100047301	康龙化成	2022 年 2 月 21 日	5,200,200.00	45,000	14	3.40	6,875.82	-	-
华泰证券	2022022100047307	阳光电源	2022 年 2 月 21 日	890,820.00	8,400	14	3.40	1,177.86	-	-
华泰证券	2022022100047311	华大基因	2022 年 2 月 21 日	706,080.00	8,000	14	3.40	933.59	-	-
华泰证券	20220221000	华大基因	2022 年 2 月	1,306,248.00	14,800	14	3.40	1,727.15	-	-

	47313		21 日							
华泰证券	2022022100047315	华大基因	2022 年 2 月 21 日	353,040.00	4,000	14	3.40	466.80	-	-
华泰证券	2022022100047317	华大基因	2022 年 2 月 21 日	1,323,900.00	15,000	14	3.40	1,750.49	-	-
华泰证券	2022022100047319	华大基因	2022 年 2 月 21 日	132,390.00	1,500	14	3.40	175.05	-	-
华泰证券	2022022100047321	华大基因	2022 年 2 月 21 日	1,632,810.00	18,500	14	3.40	2,158.94	-	-
华泰证券	2022022100047323	东方财富	2022 年 2 月 21 日	7,845,000.00	300,000	14	3.40	10,372.83	-	-
华泰证券	2022022100047325	东方财富	2022 年 2 月 21 日	6,001,425.00	229,500	14	3.40	7,935.22	-	-
华泰证券	2022022100047329	亿纬锂能	2022 年 2 月 21 日	1,201,900.00	14,000	14	3.40	1,589.18	-	-
华泰证券	2022022100047335	华熙生物	2022 年 2 月 21 日	1,169,000.00	10,000	14	3.40	1,545.68	-	-
华泰证券	2022022100047351	温氏股份	2022 年 2 月 21 日	4,886,388.00	236,400	14	3.40	6,460.89	-	-
华泰证券	2022022200000463	晶盛机电	2022 年 2 月 22 日	120,200.00	2,000	14	3.40	158.93	-	-
华泰证券	2022022200011069	英科医疗	2022 年 2 月 22 日	87,159.00	1,700	14	3.40	115.24	-	-
华泰证券	2022022200011071	蓝思科技	2022 年 2 月 22 日	62,952.00	4,300	14	3.40	83.24	-	-
华泰证券	2022022200011075	英科医疗	2022 年 2 月 22 日	51,270.00	1,000	14	3.40	67.79	-	-
华泰证券	2022022200011081	沪硅产业	2022 年 2 月 22 日	903,200.00	40,000	14	3.40	1,194.23	-	-
华泰证券	2022022200011083	宋城演艺	2022 年 2 月 22 日	166,813.00	10,700	14	3.40	220.56	-	-
华泰证券	2022022200011085	宋城演艺	2022 年 2 月 22 日	626,718.00	40,200	14	3.40	828.66	-	-
华泰证券	2022022200011087	华大基因	2022 年 2 月 22 日	949,827.00	11,100	14	3.40	1,255.88	-	-
华泰证券	2022022200011091	华大基因	2022 年 2 月 22 日	616,104.00	7,200	14	3.40	814.63	-	-
华泰证券	2022022200011093	华大基因	2022 年 2 月 22 日	1,283,550.00	15,000	14	3.40	1,697.14	-	-
华泰证券	2022022200011095	华大基因	2022 年 2 月 22 日	256,710.00	3,000	14	3.40	339.43	-	-
华泰证券	2022022200011097	康龙化成	2022 年 2 月 22 日	558,110.00	4,900	14	3.40	737.95	-	-

华泰证券	2022022200011099	东方财富	2022 年 2 月 22 日	7,614,000.00	300,000	14	3.40	10,067.40	-	-
华泰证券	2022022200011101	汇川技术	2022 年 2 月 22 日	6,295,000.00	100,000	14	3.40	8,323.39	-	-
华泰证券	2022022300011588	蓝思科技	2022 年 2 月 23 日	169,232.00	11,200	14	3.40	223.76	-	-
华泰证券	2022022300011596	健帆生物	2022 年 2 月 23 日	84,438.00	1,800	14	3.40	111.65	-	-
华泰证券	2022022300013526	宋城演艺	2022 年 2 月 23 日	972,720.00	63,000	14	3.40	1,286.15	-	-
华泰证券	2022022300013530	先导智能	2022 年 2 月 23 日	4,897,697.00	76,300	14	3.40	6,475.84	-	-
华泰证券	2022022300013538	金山办公	2022 年 2 月 23 日	6,579,000.00	30,000	14	3.40	8,698.90	-	-
华泰证券	2022022300013544	沪硅产业	2022 年 2 月 23 日	4,766,000.00	200,000	14	3.40	6,301.71	-	-
华泰证券	2022021000013528	东方财富	2022 年 2 月 10 日	16,446,038.00	511,700	28	3.40	43,490.63	-	-
华泰证券	2022022400011333	金山办公	2022 年 2 月 24 日	4,153,000.00	20,000	14	3.60	5,814.20	-	-
华泰证券	2022022400011987	康龙化成	2022 年 2 月 24 日	10,008,264.00	86,100	14	3.40	13,233.15	-	-
华泰证券	2022022400011989	沪硅产业	2022 年 2 月 24 日	586,750.00	25,000	14	3.40	775.81	-	-
华泰证券	2022021100020144	东方财富	2022 年 2 月 11 日	3,173,000.00	100,000	28	3.40	8,390.82	-	-
华泰证券	2022022500018961	爱尔眼科	2022 年 2 月 25 日	321,958.00	9,100	14	3.40	425.70	-	-
华泰证券	2022022500018979	英科医疗	2022 年 2 月 25 日	500,247.00	9,900	14	3.40	661.44	-	-
华泰证券	2022021400003324	阳光电源	2022 年 2 月 14 日	3,890,106.00	40,700	28	3.40	10,287.17	-	-
华泰证券	2022022800003341	英科医疗	2022 年 2 月 28 日	850,418.00	16,600	14	3.40	1,124.44	-	-
华泰证券	2022030100001220	天合光能	2022 年 3 月 1 日	3,392,100.00	45,000	14	3.40	4,485.11	-	-
华泰证券	2022030200003459	英科医疗	2022 年 3 月 2 日	524,785.00	10,300	14	3.40	693.88	-	-
华泰证券	2022030300000777	天合光能	2022 年 3 月 3 日	8,382,000.00	110,000	14	3.40	11,082.87	-	-
华泰证券	2022030700036372	亿纬锂能	2022 年 3 月 7 日	1,047,060.00	14,000	14	3.40	1,384.45	-	-
华泰证券	20220307000沃森生物	沃森生物	2022 年 3 月 7 日	486,304.00	11,200	14	3.40	643.00	-	-

	36374		日							
华泰证券	20220307000 36376	沃森生物	2022年3月7 日	1,189,708.00	27,400	14	3.40	1,573.06	-	-
华泰证券	20220307000 36380	温氏股份	2022年3月7 日	4,893,480.00	236,400	14	3.40	6,470.27	-	-
华泰证券	20220307000 36386	阳光电源	2022年3月7 日	1,040,928.00	8,400	14	3.40	1,376.34	-	-
华泰证券	20220307000 36388	智飞生物	2022年3月7 日	2,536,144.00	20,800	14	3.40	3,353.35	-	-
华泰证券	20220307000 36390	汇川技术	2022年3月7 日	6,018,000.00	100,300	14	3.40	7,957.13	-	-
华泰证券	20220307000 36392	智飞生物	2022年3月7 日	3,731,058.00	30,600	14	3.40	4,933.29	-	-
华泰证券	20220307000 36394	智飞生物	2022年3月7 日	4,450,445.00	36,500	14	3.40	5,884.48	-	-
华泰证券	20220307000 36676	康龙化成	2022年3月7 日	4,860,000.00	45,000	14	3.40	6,426.00	-	-
华泰证券	20220307000 36678	华大基因	2022年3月7 日	1,214,784.00	14,800	14	3.40	1,606.21	-	-
华泰证券	20220307000 36680	华大基因	2022年3月7 日	1,231,200.00	15,000	14	3.40	1,627.92	-	-
华泰证券	20220307000 36684	华大基因	2022年3月7 日	1,518,480.00	18,500	14	3.40	2,007.77	-	-
华泰证券	20220307000 36686	华大基因	2022年3月7 日	656,640.00	8,000	14	3.40	868.22	-	-
华泰证券	20220307000 36690	华大基因	2022年3月7 日	328,320.00	4,000	14	3.40	434.11	-	-
华泰证券	20220307000 36694	华大基因	2022年3月7 日	123,120.00	1,500	14	3.40	162.79	-	-
华泰证券	20220307000 36696	泰格医药	2022年3月7 日	9,126,000.00	100,000	14	3.40	12,066.60	-	-
华泰证券	20220307000 36700	华熙生物	2022年3月7 日	1,151,500.00	10,000	14	3.40	1,522.54	-	-
华泰证券	20220307000 36710	欧普康视	2022年3月7 日	930,000.00	25,000	14	3.40	1,229.67	-	-
华泰证券	20220307000 37856	英科医疗	2022年3月7 日	100,440.00	2,000	14	3.40	132.80	-	-
华泰证券	20220307000 37858	东方财富	2022年3月7 日	7,464,000.00	300,000	14	3.40	9,869.07	-	-
华泰证券	20220307000 37860	英科医疗	2022年3月7 日	190,836.00	3,800	14	3.40	252.33	-	-
华泰证券	20220308000 12444	东方财富	2022年3月8 日	7,458,000.00	300,000	14	3.40	9,861.13	-	-

华泰证券	2022030800012956	汇川技术	2022 年 3 月 8 日	5,947,000.00	100,000	14	3.40	7,863.26	-	-
华泰证券	2022030800012966	蓝思科技	2022 年 3 月 8 日	56,674.00	4,300	14	3.40	74.94	-	-
华泰证券	2022030800012970	华大基因	2022 年 3 月 8 日	853,812.00	11,100	14	3.40	1,128.93	-	-
华泰证券	2022030800012972	沪硅产业	2022 年 3 月 8 日	936,000.00	40,000	14	3.40	1,237.60	-	-
华泰证券	2022030800012974	康龙化成	2022 年 3 月 8 日	523,124.00	4,900	14	3.40	691.69	-	-
华泰证券	2022030800012976	华大基因	2022 年 3 月 8 日	230,760.00	3,000	14	3.40	305.12	-	-
华泰证券	2022030800012978	华大基因	2022 年 3 月 8 日	1,153,800.00	15,000	14	3.40	1,525.58	-	-
华泰证券	2022030800012980	华大基因	2022 年 3 月 8 日	553,824.00	7,200	14	3.40	732.28	-	-
华泰证券	2022030800012984	晶盛机电	2022 年 3 月 8 日	120,880.00	2,000	14	3.40	159.83	-	-
华泰证券	2022030800012986	英科医疗	2022 年 3 月 8 日	48,050.00	1,000	14	3.40	63.53	-	-
华泰证券	2022030800012988	英科医疗	2022 年 3 月 8 日	81,685.00	1,700	14	3.40	108.01	-	-
华泰证券	2022030900015781	先导智能	2022 年 3 月 9 日	4,191,922.00	76,300	14	3.40	5,542.65	-	-
华泰证券	2022030900015785	宋城演艺	2022 年 3 月 9 日	846,720.00	63,000	14	3.40	1,119.55	-	-
华泰证券	2022030900018107	金山办公	2022 年 3 月 9 日	5,460,000.00	30,000	14	3.40	7,219.33	-	-
华泰证券	2022030900018111	蓝思科技	2022 年 3 月 9 日	143,248.00	11,200	14	3.40	189.41	-	-
华泰证券	2022030900018113	沪硅产业	2022 年 3 月 9 日	4,812,000.00	200,000	14	3.40	6,362.53	-	-
华泰证券	2022031000012554	沪硅产业	2022 年 3 月 10 日	637,500.00	25,000	14	3.40	842.92	-	-
华泰证券	2022031000013042	康龙化成	2022 年 3 月 10 日	9,056,859.00	86,100	14	3.40	11,975.18	-	-
华泰证券	2022031100016146	英科医疗	2022 年 3 月 11 日	483,813.00	9,900	14	3.40	639.71	-	-
华泰证券	2022030100001222	天合光能	2022 年 3 月 1 日	753,800.00	10,000	28	3.40	1,993.38	-	-
华泰证券	2022031500010183	天合光能	2022 年 3 月 15 日	3,199,500.00	45,000	14	3.40	4,230.45	-	-
华泰证券	20220303000	天合光能	2022 年 3 月 3 日	9,144,000.00	120,000	28	3.40	24,180.80	-	-

	00782		日							
华泰证券	20220317000 04902	天合光能	2022 年 3 月 17 日	7,493,200.00	110,000	14	3.40	9,907.68	-	-
华泰证券	20220307000 37846	华大基因	2022 年 3 月 7 日	270,864.00	3,300	28	3.40	767.45	-	-
华泰证券	20220307000 37852	英科医疗	2022 年 3 月 7 日	502,200.00	10,000	28	3.40	1,422.90	-	-
华泰证券	20220321000 32895	华大基因	2022 年 3 月 21 日	1,322,084.00	14,800	14	3.40	1,997.82	-	-
华泰证券	20220321000 32897	华大基因	2022 年 3 月 21 日	1,339,950.00	15,000	14	3.40	2,024.81	-	-
华泰证券	20220321000 32899	华大基因	2022 年 3 月 21 日	357,320.00	4,000	14	3.40	539.95	-	-
华泰证券	20220321000 32903	泰格医药	2022 年 3 月 21 日	9,437,000.00	100,000	14	3.40	14,260.36	-	-
华泰证券	20220321000 32905	温氏股份	2022 年 3 月 21 日	4,978,584.00	236,400	14	3.40	7,523.19	-	-
华泰证券	20220321000 33065	亿纬锂能	2022 年 3 月 21 日	1,195,600.00	14,000	14	3.40	1,806.68	-	-
华泰证券	20220321000 33069	汇川技术	2022 年 3 月 21 日	5,777,280.00	100,300	14	3.40	8,730.11	-	-
华泰证券	20220321000 33071	欧普康视	2022 年 3 月 21 日	911,500.00	25,000	14	3.40	1,377.38	-	-
华泰证券	20220321000 33073	英科医疗	2022 年 3 月 21 日	98,120.00	2,000	14	3.40	148.27	-	-
华泰证券	20220321000 33075	英科医疗	2022 年 3 月 21 日	186,428.00	3,800	14	3.40	281.71	-	-
华泰证券	20220321000 35023	华熙生物	2022 年 3 月 21 日	1,154,200.00	10,000	14	3.40	1,744.12	-	-
华泰证券	20220321000 35025	沃森生物	2022 年 3 月 21 日	1,641,260.00	27,400	14	3.40	2,480.13	-	-
华泰证券	20220321000 35029	沃森生物	2022 年 3 月 21 日	670,880.00	11,200	14	3.40	1,013.77	-	-
华泰证券	20220321000 35045	华大基因	2022 年 3 月 21 日	1,652,605.00	18,500	14	3.40	2,497.27	-	-
华泰证券	20220321000 35047	华大基因	2022 年 3 月 21 日	714,640.00	8,000	14	3.40	1,079.90	-	-
华泰证券	20220321000 35049	华大基因	2022 年 3 月 21 日	133,995.00	1,500	14	3.40	202.48	-	-
华泰证券	20220322000 14275	华大基因	2022 年 3 月 22 日	1,263,150.00	15,000	14	3.40	1,789.46	-	-
华泰证券	20220322000 14277	华大基因	2022 年 3 月 22 日	934,731.00	11,100	14	3.40	1,324.20	-	-

华泰证券	2022032200014281	华大基因	2022 年 3 月 22 日	606,312.00	7,200	14	3.40	858.94	-	-
华泰证券	2022032200014283	华大基因	2022 年 3 月 22 日	252,630.00	3,000	14	3.40	357.89	-	-
华泰证券	2022032200014285	汇川技术	2022 年 3 月 22 日	5,740,000.00	100,000	14	3.40	8,131.67	-	-
华泰证券	2022032200014293	沪硅产业	2022 年 3 月 22 日	1,004,400.00	40,000	14	3.40	1,422.90	-	-
华泰证券	2022032200014295	英科医疗	2022 年 3 月 22 日	47,800.00	1,000	14	3.40	67.72	-	-
华泰证券	2022032200014297	东方财富	2022 年 3 月 22 日	7,536,000.00	300,000	14	3.40	10,676.00	-	-
华泰证券	2022032200014299	英科医疗	2022 年 3 月 22 日	81,260.00	1,700	14	3.40	115.12	-	-
华泰证券	2022032200014301	晶盛机电	2022 年 3 月 22 日	124,000.00	2,000	14	3.40	175.67	-	-
华泰证券	2022032200014305	蓝思科技	2022 年 3 月 22 日	52,546.00	4,300	14	3.40	74.44	-	-
华泰证券	2022032300012491	先导智能	2022 年 3 月 23 日	4,619,202.00	76,300	14	3.40	6,107.61	-	-
华泰证券	2022032300012513	金山办公	2022 年 3 月 23 日	5,702,700.00	30,000	14	3.40	7,540.24	-	-
华泰证券	2022032300012515	沪硅产业	2022 年 3 月 23 日	4,954,000.00	200,000	14	3.40	6,550.29	-	-
华泰证券	2022032300012527	蓝思科技	2022 年 3 月 23 日	137,088.00	11,200	14	3.40	181.26	-	-
华泰证券	2022032400012803	沪硅产业	2022 年 3 月 24 日	601,250.00	25,000	14	3.40	794.99	-	-
华泰证券	2022032500018794	英科医疗	2022 年 3 月 25 日	455,202.00	9,900	14	3.40	601.88	-	-
华泰证券	2022033000000740	宋城演艺	2022 年 3 月 30 日	844,272.00	62,400	14	3.40	1,036.58	-	-
华泰证券	2022033100005960	天合光能	2022 年 3 月 31 日	7,068,000.00	120,000	28	3.40	8,010.40	-	-
华泰证券	2022033100005962	天合光能	2022 年 3 月 31 日	6,479,000.00	110,000	14	3.40	7,342.87	-	-
华泰证券	2022040600048665	沪硅产业	2022 年 4 月 6 日	885,600.00	40,000	14	3.40	1,170.96	-	-
华泰证券	2022040600048669	晶盛机电	2022 年 4 月 6 日	113,980.00	2,000	14	3.40	150.71	-	-
华泰证券	2022040600064091	温氏股份	2022 年 4 月 6 日	5,264,628.00	236,400	14	3.40	6,961.01	-	-
华泰证券	20220406000	华大基因	2022 年 4 月 6 日	1,513,485.00	18,500	14	3.40	2,001.16	-	-

	64093		日							
华泰证券	20220406000 64095	华大基因	2022年4月6 日	122,715.00	1,500	14	3.40	162.26	-	-
华泰证券	20220406000 64097	华大基因	2022年4月6 日	1,227,150.00	15,000	14	3.40	1,622.57	-	-
华泰证券	20220406000 64099	华大基因	2022年4月6 日	1,227,150.00	15,000	14	3.40	1,622.57	-	-
华泰证券	20220406000 64101	华大基因	2022年4月6 日	327,240.00	4,000	14	3.40	432.68	-	-
华泰证券	20220406000 64103	华大基因	2022年4月6 日	245,430.00	3,000	14	3.40	324.51	-	-
华泰证券	20220406000 64105	华大基因	2022年4月6 日	908,091.00	11,100	14	3.40	1,200.70	-	-
华泰证券	20220406000 64107	华大基因	2022年4月6 日	589,032.00	7,200	14	3.40	778.83	-	-
华泰证券	20220406000 64109	华大基因	2022年4月6 日	654,480.00	8,000	14	3.40	865.37	-	-
华泰证券	20220406000 64113	华大基因	2022年4月6 日	1,210,788.00	14,800	14	3.40	1,600.93	-	-
华泰证券	20220406000 64119	金山办公	2022年4月6 日	5,542,800.00	30,000	14	3.40	7,328.81	-	-
华泰证券	20220406000 65857	东方财富	2022年4月6 日	7,788,000.00	300,000	14	3.40	10,297.47	-	-
华泰证券	20220406000 65859	蓝思科技	2022年4月6 日	49,751.00	4,300	14	3.40	65.78	-	-
华泰证券	20220406000 65861	蓝思科技	2022年4月6 日	129,584.00	11,200	14	3.40	171.34	-	-
华泰证券	20220406000 65863	亿纬锂能	2022年4月6 日	1,110,200.00	14,000	14	3.40	1,467.93	-	-
华泰证券	20220406000 66089	沃森生物	2022年4月6 日	646,800.00	11,200	14	3.40	855.21	-	-
华泰证券	20220406000 66091	沃森生物	2022年4月6 日	1,582,350.00	27,400	14	3.40	2,092.22	-	-
华泰证券	20220406000 66097	先导智能	2022年4月6 日	4,129,356.00	76,300	14	3.40	5,459.93	-	-
华泰证券	20220406000 66101	泰格医药	2022年4月6 日	10,588,000.00	100,000	14	3.40	13,999.69	-	-
华泰证券	20220406000 66107	欧普康视	2022年4月6 日	881,250.00	25,000	14	3.40	1,165.21	-	-
华泰证券	20220408000 14673	英科医疗	2022年4月8 日	441,738.00	9,900	14	3.40	584.08	-	-
华泰证券	20220413000 10362	宋城演艺	2022年4月 13日	834,912.00	62,400	14	3.40	1,103.94	-	-

华泰证券	20220414000 06337	天合光能	2022 年 4 月 14 日	5,320,700.00	110,000	14	3.40	7,035.15	-	-
华泰证券	20220406000 00812	中国通号	2022 年 4 月 6 日	179,601.00	39,300	28	3.40	491.91	-	-
华泰证券	20220406000 64111	华大基因	2022 年 4 月 6 日	269,973.00	3,300	28	3.40	739.43	-	-
华泰证券	20220420000 00614	同花顺	2022 年 4 月 20 日	1,143,324.00	12,600	14	3.40	1,619.71	-	-
华泰证券	20220420000 00616	华润微	2022 年 4 月 20 日	486,500.00	10,000	14	3.40	689.21	-	-
华泰证券	20220420000 38494	温氏股份	2022 年 4 月 20 日	5,144,064.00	236,400	14	3.40	7,287.42	-	-
华泰证券	20220420000 38496	华大基因	2022 年 4 月 20 日	584,560.00	8,000	14	3.40	828.13	-	-
华泰证券	20220420000 38498	华大基因	2022 年 4 月 20 日	811,077.00	11,100	14	3.40	1,149.03	-	-
华泰证券	20220420000 38500	华大基因	2022 年 4 月 20 日	109,605.00	1,500	14	3.40	155.27	-	-
华泰证券	20220420000 38502	华大基因	2022 年 4 月 20 日	1,096,050.00	15,000	14	3.40	1,552.74	-	-
华泰证券	20220420000 38504	华大基因	2022 年 4 月 20 日	1,351,795.00	18,500	14	3.40	1,915.04	-	-
华泰证券	20220420000 38508	华大基因	2022 年 4 月 20 日	292,280.00	4,000	14	3.40	414.06	-	-
华泰证券	20220420000 38510	华大基因	2022 年 4 月 20 日	1,096,050.00	15,000	14	3.40	1,552.74	-	-
华泰证券	20220420000 38512	华大基因	2022 年 4 月 20 日	219,210.00	3,000	14	3.40	310.55	-	-
华泰证券	20220420000 38514	华大基因	2022 年 4 月 20 日	526,104.00	7,200	14	3.40	745.31	-	-
华泰证券	20220420000 38516	华大基因	2022 年 4 月 20 日	1,081,436.00	14,800	14	3.40	1,532.03	-	-
华泰证券	20220420000 38864	东方财富	2022 年 4 月 20 日	6,183,000.00	300,000	14	3.40	8,759.25	-	-
华泰证券	20220420000 38866	先导智能	2022 年 4 月 20 日	3,578,470.00	76,300	14	3.40	5,069.50	-	-
华泰证券	20220420000 46432	沃森生物	2022 年 4 月 20 日	1,563,992.00	27,400	14	3.40	2,215.66	-	-
华泰证券	20220420000 46436	沃森生物	2022 年 4 月 20 日	639,296.00	11,200	14	3.40	905.67	-	-
华泰证券	20220420000 46438	金山办公	2022 年 4 月 20 日	5,454,000.00	30,000	14	3.40	7,726.50	-	-
华泰证券	20220420000	欧普康视	2022 年 4 月	873,750.00	25,000	14	3.40	1,237.81	-	-

	46446		20 日							
华泰证券	20220420000 46904	沪硅产业	2022 年 4 月 20 日	896,000.00	40,000	14	3.40	1,269.33	-	-
华泰证券	20220422000 17046	英科医疗	2022 年 4 月 22 日	395,406.00	9,900	14	3.40	522.81	-	-
华泰证券	20220427000 11717	宋城演艺	2022 年 4 月 27 日	760,032.00	62,400	14	3.40	1,004.93	-	-
华泰证券	20220428000 06890	天合光能	2022 年 4 月 28 日	5,346,000.00	110,000	14	3.40	7,068.60	-	-
华泰证券	20220505000 70241	华润微	2022 年 5 月 5 日	484,700.00	10,000	14	3.40	640.88	-	-
华泰证券	20220505000 70243	华大基因	2022 年 5 月 5 日	1,193,620.00	18,500	14	3.40	1,578.23	-	-
华泰证券	20220505000 70245	华大基因	2022 年 5 月 5 日	967,800.00	15,000	14	3.40	1,279.65	-	-
华泰证券	20220505000 70247	华大基因	2022 年 5 月 5 日	954,896.00	14,800	14	3.40	1,262.58	-	-
华泰证券	20220505000 70249	华大基因	2022 年 5 月 5 日	258,080.00	4,000	14	3.40	341.24	-	-
华泰证券	20220505000 70253	华大基因	2022 年 5 月 5 日	716,172.00	11,100	14	3.40	946.94	-	-
华泰证券	20220505000 70255	华大基因	2022 年 5 月 5 日	516,160.00	8,000	14	3.40	682.48	-	-
华泰证券	20220505000 70261	华大基因	2022 年 5 月 5 日	96,780.00	1,500	14	3.40	127.96	-	-
华泰证券	20220505000 70263	华大基因	2022 年 5 月 5 日	967,800.00	15,000	14	3.40	1,279.65	-	-
华泰证券	20220505000 70269	华大基因	2022 年 5 月 5 日	193,560.00	3,000	14	3.40	255.93	-	-
华泰证券	20220505000 70271	欧普康视	2022 年 5 月 5 日	928,250.00	25,000	14	3.40	1,227.35	-	-
华泰证券	20220505000 70273	金山办公	2022 年 5 月 5 日	5,781,300.00	30,000	14	3.40	7,644.16	-	-
华泰证券	20220505000 70287	东方财富	2022 年 5 月 5 日	6,720,000.00	300,000	14	3.40	8,885.33	-	-
华泰证券	20220505000 70291	沃森生物	2022 年 5 月 5 日	1,413,292.00	27,400	14	3.40	1,868.69	-	-
华泰证券	20220505000 70305	沃森生物	2022 年 5 月 5 日	577,696.00	11,200	14	3.40	763.84	-	-
华泰证券	20220505000 70329	同花顺	2022 年 5 月 5 日	1,021,986.00	12,600	14	3.40	1,351.29	-	-
华泰证券	20220505000 70333	沪硅产业	2022 年 5 月 5 日	846,000.00	40,000	14	3.40	1,118.60	-	-

华泰证券	2022050500070351	先导智能	2022 年 5 月 5 日	3,409,084.00	76,300	14	3.40	4,507.57	-	-
华泰证券	2022050600000395	爱美客	2022 年 5 月 6 日	3,022,720.00	6,400	14	3.40	3,996.71	-	-
华泰证券	2022050600014325	英科医疗	2022 年 5 月 6 日	274,824.00	9,900	14	3.40	363.38	-	-
华泰证券	2022051100008740	宋城演艺	2022 年 5 月 11 日	732,576.00	62,400	14	3.40	968.63	-	-
华泰证券	2022042800006892	天合光能	2022 年 4 月 28 日	5,832,000.00	120,000	28	3.40	15,422.40	-	-
华泰证券	2022051200008304	天合光能	2022 年 5 月 12 日	6,118,200.00	110,000	14	3.40	8,089.62	-	-
华泰证券	2022050500070251	华大基因	2022 年 5 月 5 日	212,916.00	3,300	28	3.40	563.04	-	-
华泰证券	2022050500070289	中国通号	2022 年 5 月 5 日	173,313.00	39,300	28	3.40	458.32	-	-
华泰证券	2022051900044979	东方财富	2022 年 5 月 19 日	6,651,000.00	300,000	14	3.40	8,794.10	-	-
华泰证券	2022051900044985	先导智能	2022 年 5 月 19 日	3,740,226.00	76,300	14	3.40	4,945.41	-	-
华泰证券	2022051900044993	金山办公	2022 年 5 月 19 日	6,228,000.00	30,000	14	3.40	8,234.80	-	-
华泰证券	2022051900045001	同花顺	2022 年 5 月 19 日	1,026,774.00	12,600	14	3.40	1,357.62	-	-
华泰证券	2022052300000531	欧普康视	2022 年 5 月 23 日	816,640.00	22,000	14	3.40	1,079.78	-	-
华泰证券	2022052400000820	欧普康视	2022 年 5 月 24 日	703,400.00	20,000	14	3.40	930.05	-	-
华泰证券	2022052700000410	石头科技	2022 年 5 月 27 日	5,659,900.00	10,000	14	3.40	7,483.65	-	-
华泰证券	2022053000000479	温氏股份	2022 年 5 月 30 日	38,852.00	2,200	14	3.40	51.37	-	-
华泰证券	2022053000000481	康泰生物	2022 年 5 月 30 日	5,993,417.00	95,300	14	3.40	7,924.63	-	-
华泰证券	2022060100000871	天合光能	2022 年 6 月 1 日	12,899,052.00	212,400	14	3.40	17,055.41	-	-
华泰证券	2022060200016756	同花顺	2022 年 6 月 2 日	1,072,386.00	12,600	14	3.40	1,417.93	-	-
华泰证券	2022060200022086	金山办公	2022 年 6 月 2 日	6,306,900.00	30,000	14	3.40	8,339.12	-	-
华泰证券	2022060200022094	先导智能	2022 年 6 月 2 日	3,918,005.00	76,300	14	3.40	5,180.47	-	-
华泰证券	202206060000	爱尔眼科	2022 年 6 月 6 日	1,025,451.00	28,700	14	3.40	1,355.87	-	-

	00632		日							
华泰证券	202206060009622	欧普康视	2022年6月6日	1,004,300.00	22,000	14	3.40	1,327.91	-	-
华泰证券	202206070008702	欧普康视	2022年6月7日	886,000.00	20,000	14	3.40	1,171.49	-	-
华泰证券	2022060800000839	温氏股份	2022年6月8日	9,130,000.00	500,000	14	3.40	12,071.89	-	-
华泰证券	2022061000004043	石头科技	2022年6月10日	6,893,400.00	10,000	14	3.40	9,114.61	-	-
华泰证券	2022061300002227	天合光能	2022年6月13日	3,913,000.00	65,000	14	3.40	5,173.86	-	-
华泰证券	2022061300002235	贝泰妮	2022年6月13日	6,304,320.00	32,000	14	3.40	8,335.71	-	-
华泰证券	2022061300002237	中伟股份	2022年6月13日	6,425,000.00	50,000	14	3.40	8,495.28	-	-
华泰证券	2022061300019249	康泰生物	2022年6月13日	3,737,666.00	95,300	14	3.40	4,942.03	-	-
华泰证券	2022061500001692	亿联网络	2022年6月15日	2,865,240.00	37,800	14	3.40	3,788.48	-	-
华泰证券	2022061500022653	天合光能	2022年6月15日	11,735,100.00	212,400	14	3.40	15,516.41	-	-
华泰证券	2022061600014943	先导智能	2022年6月16日	4,693,213.00	76,300	14	3.40	6,205.47	-	-
华泰证券	2022061600015563	金山办公	2022年6月16日	6,212,100.00	30,000	14	3.40	8,213.78	-	-
华泰证券	2022061600015577	同花顺	2022年6月16日	1,201,788.00	12,600	14	3.40	1,589.03	-	-
华泰证券	2022062000000933	华润微	2022年6月20日	911,818.00	15,800	14	3.40	1,205.63	-	-
华泰证券	2022062000011958	欧普康视	2022年6月20日	1,200,760.00	22,000	14	3.40	1,587.67	-	-
华泰证券	2022062000012290	爱尔眼科	2022年6月20日	1,175,552.00	28,700	14	3.40	1,554.34	-	-
华泰证券	2022061500001693	同花顺	2022年6月15日	180,810.00	1,800	28	3.40	358.61	173,070.00	358.61
华泰证券	2022061500001698	爱尔眼科	2022年6月15日	5,354,240.00	142,400	28	3.40	10,619.24	6,375,248.00	10,619.24
华泰证券	2022062100009082	欧普康视	2022年6月21日	1,065,400.00	20,000	14	3.40	1,408.70	1,143,800.00	1,408.70
华泰证券	2022062200000621	爱美客	2022年6月22日	1,039,756.00	1,900	14	3.40	1,374.79	1,140,019.00	1,374.79
华泰证券	2022062200013491	温氏股份	2022年6月22日	11,005,000.00	500,000	14	3.40	14,551.06	10,645,000.00	14,551.06

华泰证券	2022062400008692	石头科技	2022 年 6 月 24 日	6,410,000.00	10,000	14	3.40	7,264.67	6,167,000.00	7,264.67
华泰证券	2022062700015376	贝泰妮	2022 年 6 月 27 日	7,130,560.00	32,000	14	3.40	6,060.98	6,960,960.00	6,060.98
华泰证券	2022062700015378	中伟股份	2022 年 6 月 27 日	6,378,000.00	50,000	14	3.40	5,421.30	6,195,000.00	5,421.30
华泰证券	2022062700015382	天合光能	2022 年 6 月 27 日	4,386,850.00	65,000	14	3.40	3,728.82	4,241,250.00	3,728.82
华泰证券	2022062900001182	阳光电源	2022 年 6 月 29 日	8,832,390.00	95,900	14	3.40	5,839.19	9,422,175.00	5,839.19
华泰证券	2022062900024444	天合光能	2022 年 6 月 29 日	14,135,220.00	212,400	14	3.40	9,344.95	13,859,100.00	9,344.95
华泰证券	2022063000016007	先导智能	2022 年 6 月 30 日	4,820,634.00	76,300	14	3.40	2,731.69	4,820,634.00	2,731.69
华泰证券	2022063000016009	同花顺	2022 年 6 月 30 日	1,211,490.00	12,600	14	3.40	686.51	1,211,490.00	686.51

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

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

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（%）
华泰柏瑞沪 深300交易型 开放式指数 证券投资基金 联接基金	602,642,065.00	3.2537	1,145,234,077.00	5.8159
华泰证券股 份有限公司	41,033,223.00	0.2215	515,934,470.00	2.6201

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	537,725,236.60	489,570.60	234,917,672.44	402,252.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

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
华泰联合证券	301408	华人健康	网下申购	8,784	142,652.16
华泰联合证券	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
华泰联合证券	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合证券	603137	恒尚节能	网下申购	1,382	21,973.80
华泰联合证券	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86
华泰联合证券	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合证券	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20
华泰联合证券	300804	广康生化	网下申购	2,257	95,809.65
华泰联合证券	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合证券	118031	天 23 转债	网上配售	147,310	14,731,000.00
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投 资形 式 发放 总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 1 月 16 日	-	2023 年 1 月 16 日	0.6400	1,193,215,211.55	-	1,193,215,211.55	-
合计	-	-	-	0.6400	1,193,215,211.55	-	1,193,215,211.55	-

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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	27.93	33.03	105	105.00	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	9.60	9.41	3,767	3,767.00	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	11.88	21.02	1,386	1,386.00	29,133.72	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	18.88	19.60	114	114.00	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	20.68	25.49	145	145.00	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	15.38	14.87	177	177.00	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	44.48	39.48	55	55.00	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	28.84	30.78	170	170.00	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	41.20	42.69	262	262.00	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内 (含)	新股未上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
301225	恒勃股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内 (含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	44.18	25.10	338	241.00	8,483.80	-

301291	明阳电 气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新 源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内 (含)	新股未上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301293	三博脑 科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁定期内	29.60	71.42	333	333.00	23,782.86	-
301295	美硕科 技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301305	朗坤环 境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	25.25	19.69	753	753.00	14,826.57	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股 份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智 能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯 特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	76.80	107.95	364	364.00	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	14.81	13.73	1,122	1,122.00	15,405.06	-
301337	亚华电 子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	32.60	30.37	232	232.00	7,045.84	-
301345	涛涛车 业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科 技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长 龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	50.00	48.39	190	190.00	9,194.10	-
301358	湖南裕 能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科 技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股锁定期内	71.88	92.60	111	111.00	10,278.60	-
301373	凌玮科 技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科 技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	23.80	32.84	408	408.00	13,398.72	-
301386	未来电 器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股	2023 年 6 月	6 个月	新股锁定期内	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-

	份	15 日								
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	43.99	51.57	293	293.00	15,110.01	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	26.35	30.60	229	229.00	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	28.75	21.02	499	499.00	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
301488	豪恩汽车电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
301488	豪恩汽车电	2023 年 6 月 26 日	1 个月内 (含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期内	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁定期内	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	硕中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定期内	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-

688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁定期内	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期内	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期内	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁定期内	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定期内	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688515	裕太微	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	92.00	162.75	4,183	384,836.00	680,783.25	-
688522	纳睿雷达	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股锁定期内	46.68	51.50	4,299	200,677.32	221,398.50	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁定期内	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定期内	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定期内	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期内	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定期内	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股锁定期内	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月	6 个月	新股锁定期内	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-

		15 日								
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁定期内	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定期内	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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

注：本基金本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

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

注：截止本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截止本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

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（单位：股）	期末估值总额
1	000001	平安银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	11.23	62,100	697,383.00
2	000338	潍柴动力	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	12.46	39,200	488,432.00
3	300454	深信服	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	113.25	8,800	996,600.00

4	300496	中科创达	2023 年 7 月 10 日	96.35	1,700	163,795.00
5	300498	温氏股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	18.35	32,800	601,880.00
6	300601	康泰生物	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	25.39	82,900	2,104,831.00
7	300628	亿联网络	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	35.07	24,100	845,187.00
8	300661	圣邦股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	82.13	208,300	17,107,679.00
9	300750	宁德时代	2023 年 7 月 10 日	228.79	14,200	3,248,818.00
10	300751	迈为股份	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	169.38	24,500	4,149,810.00
11	300759	康龙化成	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	38.28	88,000	3,368,640.00
12	300760	迈瑞医疗	2023 年 7 月 10 日	299.80	2,600	779,480.00
13	000408	藏格矿业	2023 年 7 月 1 日-2023 年 7 月 13 日	22.57	114,500	2,584,265.00
14	300763	锦浪科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	104.10	128,000	13,324,800.00
15	300769	德方纳米	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	110.23	23,200	2,557,336.00
16	300782	卓胜微	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	96.63	25,000	2,415,750.00
17	300896	爱美客	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	444.95	15,000	6,674,250.00
18	300919	中伟股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	60.25	6,500	391,625.00
19	300957	贝泰妮	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	88.88	80,000	7,110,400.00
20	300979	华利集团	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 24 日	48.74	86,800	4,230,632.00
21	300999	金龙鱼	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	39.99	33,700	1,347,663.00
22	600000	浦发银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	7.24	73,100	529,244.00
23	600009	上海机场	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	45.42	16,700	758,514.00
24	000425	徐工机械	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	6.77	35,400	239,658.00
25	600010	包钢股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	1.79	132,000	236,280.00
26	600011	华能国际	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	9.26	63,700	589,862.00
27	600015	华夏银行	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	5.41	349,300	1,889,713.00
28	600016	民生银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	3.75	143,400	537,750.00
29	600018	上港集团	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	5.25	25,000	131,250.00
30	600019	宝钢股份	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	5.62	498,800	2,803,256.00
31	600025	华能水电	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	7.13	222,200	1,584,286.00
32	600028	中国石化	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	6.36	668,600	4,252,296.00
33	600029	南方航空	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	6.03	1,184,900	7,144,947.00
34	600030	中信证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	19.78	62,500	1,236,250.00
35	000538	云南白药	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	52.48	14,900	781,952.00
36	600031	三一重工	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	16.63	297,100	4,940,773.00
37	600036	招商银行	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	32.76	111,100	3,639,636.00
38	600039	四川路桥	2023 年 7 月 10 日	9.81	10,100	99,081.00
39	600048	保利发展	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	13.03	511,000	6,658,330.00
40	600050	中国联通	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	4.80	112,500	540,000.00
41	600061	国投资本	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	7.12	282,400	2,010,688.00
42	600085	同仁堂	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	57.56	113,700	6,544,572.00
43	600089	特变电工	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	22.29	41,800	931,722.00
44	600104	上汽集团	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	14.17	35,100	497,367.00
45	600111	北方稀土	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	23.98	83,600	2,004,728.00
46	000568	泸州老窖	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	209.57	5,000	1,047,850.00

47	600115	中国东航	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 27 日	4.76	4,996,000	23,780,960.00
48	600132	重庆啤酒	2023 年 7 月 10 日	92.16	1,300	119,808.00
49	600150	中国船舶	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	32.91	752,600	24,768,066.00
50	600176	中国巨石	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	14.16	45,800	648,528.00
51	600183	生益科技	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	14.20	176,300	2,503,460.00
52	600188	兖矿能源	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	29.92	374,800	11,214,016.00
53	600196	复星医药	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	30.90	16,900	522,210.00
54	600219	南山铝业	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	3.02	331,400	1,000,828.00
55	600233	圆通速递	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	14.56	19,300	281,008.00
56	600276	恒瑞医药	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	47.90	33,900	1,623,810.00
57	000596	古井贡酒	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	247.38	21,000	5,194,980.00
58	600309	万华化学	2023 年 7 月 10 日	87.84	10,100	887,184.00
59	600332	白云山	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	31.88	18,200	580,216.00
60	600346	恒力石化	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	14.33	604,200	8,658,186.00
61	600362	江西铜业	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	18.98	26,700	506,766.00
62	600383	金地集团	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	7.21	308,200	2,222,122.00
63	600406	国电南瑞	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	23.10	28,000	646,800.00
64	600426	华鲁恒升	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	30.63	22,400	686,112.00
65	600436	片仔癀	2023 年 7 月 10 日	286.36	1,600	458,176.00
66	600438	通威股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	34.31	1,222,400	41,940,544.00
67	600460	士兰微	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	30.27	568,000	17,193,360.00
68	000617	中油资本	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	7.23	1,644,000	11,886,120.00
69	600519	贵州茅台	2023 年 7 月 10 日	1,691.00	3,400	5,749,400.00
70	600547	山东黄金	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	23.48	196,700	4,618,516.00
71	600570	恒生电子	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	44.29	68,200	3,020,578.00
72	600584	长电科技	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	31.17	57,700	1,798,509.00
73	600585	海螺水泥	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	23.74	28,000	664,720.00
74	600588	用友网络	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	20.50	21,100	432,550.00
75	600600	青岛啤酒	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	103.63	6,800	704,684.00
76	600606	绿地控股	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	2.75	32,700	89,925.00
77	600660	福耀玻璃	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	35.85	66,100	2,369,685.00
78	600674	川投能源	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	15.05	22,000	331,100.00
79	000625	长安汽车	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	12.93	3,225,800	41,709,594.00
80	600690	海尔智家	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	23.48	34,800	817,104.00
81	600732	爱旭股份	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 11 日	30.75	774,300	23,809,725.00
82	600741	华域汽车	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	18.46	270,500	4,993,430.00
83	600745	闻泰科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 28 日	48.90	623,000	30,464,700.00
84	600754	锦江酒店	2023 年 7 月 10 日	42.34	2,500	105,850.00
85	600760	中航沈飞	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	45.00	16,020	720,900.00
86	600763	通策医疗	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	96.86	11,200	1,084,832.00
87	600795	国电电力	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	3.83	57,900	221,757.00
88	600803	新奥股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	18.98	34,800	660,504.00
89	600809	山西汾酒	2023 年 7 月 10 日	185.07	2,600	481,182.00

90	000651	格力电器	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	36.51	34,200	1,248,642.00
91	600837	海通证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	9.22	61,900	570,718.00
92	600845	宝信软件	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	50.81	19,600	995,876.00
93	600875	东方电气	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	18.65	9,500	177,175.00
94	600884	杉杉股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	15.14	40,100	607,114.00
95	600886	国投电力	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	12.65	26,000	328,900.00
96	600887	伊利股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	28.32	44,200	1,251,744.00
97	600893	航发动力	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	42.26	18,200	769,132.00
98	600900	长江电力	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	22.06	108,400	2,391,304.00
99	600905	三峡能源	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	5.37	441,600	2,371,392.00
100	600918	中泰证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	6.91	25,000	172,750.00
101	000661	长春高新	2023 年 7 月 10 日	136.30	1,800	245,340.00
102	600919	江苏银行	2023 年 7 月 10 日	7.35	63,500	466,725.00
103	600926	杭州银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	11.75	26,000	305,500.00
104	600941	中国移动	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	93.30	37,800	3,526,740.00
105	600958	东方证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	9.70	38,100	369,570.00
106	600989	宝丰能源	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	12.61	21,800	274,898.00
107	600999	招商证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	13.57	30,000	407,100.00
108	601006	大秦铁路	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	7.43	2,411,500	17,917,445.00
109	601009	南京银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	8.00	37,800	302,400.00
110	601012	隆基绿能	2023 年 7 月 10 日	28.67	32,600	934,642.00
111	601021	春秋航空	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	57.47	169,300	9,729,671.00
112	000002	万科 A	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	14.02	46,600	653,332.00
113	000708	中信特钢	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	15.84	74,700	1,183,248.00
114	601066	中信建投	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	24.20	17,000	411,400.00
115	601088	中国神华	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	30.75	227,700	7,001,775.00
116	601100	恒立液压	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	64.33	355,000	22,837,150.00
117	601111	中国国航	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	8.24	3,053,800	25,163,312.00
118	601117	中国化学	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	8.28	29,700	245,916.00
119	601138	工业富联	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	25.20	2,350,300	59,227,560.00
120	601155	新城控股	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	14.41	55,300	796,873.00
121	601166	兴业银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	15.65	88,100	1,378,765.00
122	601169	北京银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	4.63	89,500	414,385.00
123	601186	中国铁建	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	9.85	137,100	1,350,435.00
124	000723	美锦能源	2023 年 7 月 10 日	7.54	14,000	105,560.00
125	601211	国泰君安	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	13.99	34,200	478,458.00
126	601216	君正集团	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	4.10	877,200	3,596,520.00
127	601225	陕西煤业	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	18.19	188,500	3,428,815.00
128	601229	上海银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	5.75	63,400	364,550.00
129	601236	红塔证券	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	7.45	851,100	6,340,695.00
130	601238	广汽集团	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	10.42	32,100	334,482.00
131	601288	农业银行	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	3.53	700,600	2,473,118.00
132	601318	中国平安	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	46.40	68,200	3,164,480.00

133	601319	中国人保	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	5.84	27,200	158,848.00
134	601328	交通银行	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	5.80	502,300	2,913,340.00
135	000725	京东方 A	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	4.09	211,400	864,626.00
136	601336	新华保险	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	36.77	84,000	3,088,680.00
137	601360	三六零	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 27 日	12.54	2,491,000	31,237,140.00
138	601377	兴业证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	6.12	47,100	288,252.00
139	601390	中国中铁	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	7.58	618,900	4,691,262.00
140	601398	工商银行	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	4.82	535,000	2,578,700.00
141	601600	中国铝业	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	5.49	58,500	321,165.00
142	601601	中国太保	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	25.98	28,400	737,832.00
143	601607	上海医药	2023 年 7 月 10 日	22.41	6,000	134,460.00
144	601615	明阳智能	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	16.88	87,000	1,468,560.00
145	601618	中国中冶	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	3.97	48,400	192,148.00
146	000733	振华科技	2023 年 7 月 10 日	95.85	13,100	1,255,635.00
147	601628	中国人寿	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	34.96	52,100	1,821,416.00
148	601633	长城汽车	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 24 日	25.17	505,100	12,713,367.00
149	601658	邮储银行	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	4.89	526,000	2,572,140.00
150	601668	中国建筑	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	5.74	336,400	1,930,936.00
151	601669	中国电建	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 27 日	5.74	3,113,500	17,871,490.00
152	601688	华泰证券	2023 年 7 月 10 日	13.77	27,700	381,429.00
153	601689	拓普集团	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	80.70	193,200	15,591,240.00
154	601698	中国卫通	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	19.88	283,000	5,626,040.00
155	601699	潞安环能	2023 年 7 月 10 日	16.32	5,500	89,760.00
156	601728	中国电信	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	5.63	112,400	632,812.00
157	000768	中航西飞	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 27 日	26.75	211,700	5,662,975.00
158	601766	中国中车	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	6.50	468,700	3,046,550.00
159	601788	光大证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	15.89	20,500	325,745.00
160	601799	星宇股份	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	123.60	24,700	3,052,920.00
161	601800	中国交建	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	10.91	29,000	316,390.00
162	601808	中海油服	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	13.88	303,700	4,215,356.00
163	601816	京沪高铁	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	5.26	141,900	746,394.00
164	601818	光大银行	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	3.07	758,600	2,328,902.00
165	601838	成都银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	12.21	22,100	269,841.00
166	601857	中国石油	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	7.47	265,200	1,981,044.00
167	601865	福莱特	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	38.51	334,000	12,862,340.00
168	000776	广发证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	14.71	25,900	380,989.00
169	601868	中国能建	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	2.34	2,449,800	5,732,532.00
170	601872	招商轮船	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	5.79	18,500	107,115.00
171	601877	正泰电器	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	27.65	319,700	8,839,705.00
172	601878	浙商证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	9.88	35,700	352,716.00
173	601881	中国银河	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	11.61	613,700	7,125,057.00
174	601888	中国中免	2023 年 7 月 10 日	110.53	5,300	585,809.00
175	601898	中煤能源	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 27 日	8.44	618,400	5,219,296.00

176	601899	紫金矿业	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	11.37	98,500	1,119,945.00
177	601901	方正证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	6.54	32,100	209,934.00
178	601919	中远海控	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	9.40	61,900	581,860.00
179	000786	北新建材	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	24.51	15,300	375,003.00
180	601939	建设银行	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	6.26	291,300	1,823,538.00
181	601985	中国核电	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	7.05	262,800	1,852,740.00
182	601988	中国银行	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	3.91	642,500	2,512,175.00
183	601989	中国重工	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 27 日	4.82	427,000	2,058,140.00
184	601995	中金公司	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	35.52	735,500	26,124,960.00
185	601998	中信银行	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	5.98	325,400	1,945,892.00
186	603019	中科曙光	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 27 日	50.90	776,000	39,498,400.00
187	603185	弘元绿能	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 24 日	74.55	121,500	9,057,825.00
188	603195	公牛集团	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 12 日	96.06	73,000	7,012,380.00
189	603259	药明康德	2023 年 7 月 10 日	62.31	11,000	685,410.00
190	000792	盐湖股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	19.17	39,200	751,464.00
191	603260	合盛硅业	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	70.02	144,400	10,110,888.00
192	603288	海天味业	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 25 日	46.85	238,000	11,150,300.00
193	603290	斯达半导	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 13 日	215.20	50,700	10,910,640.00
194	603369	今世缘	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	52.80	66,400	3,505,920.00
195	603392	万泰生物	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 12 日	66.77	52,100	3,478,717.00
196	603486	科沃斯	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	77.77	145,000	11,276,650.00
197	603501	韦尔股份	2023 年 7 月 10 日	98.04	4,500	441,180.00
198	603659	璞泰来	2023 年 7 月 10 日	38.22	24,200	924,924.00
199	603799	华友钴业	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	45.91	1,096,900	50,358,679.00
200	603806	福斯特	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	37.19	14,000	520,660.00
201	000800	一汽解放	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	8.37	144,700	1,211,139.00
202	603833	欧派家居	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	95.80	8,800	843,040.00
203	603899	晨光股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	44.64	86,600	3,865,824.00
204	603986	兆易创新	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 27 日	106.25	13,600	1,445,000.00
205	603993	洛阳钼业	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	5.33	48,000	255,840.00
206	605117	德业股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	149.55	121,000	18,095,550.00
207	605499	东鹏饮料	2023 年 7 月 10 日	172.90	1,000	172,900.00
208	688005	容百科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	54.02	203,000	10,966,060.00
209	688008	澜起科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 28 日	57.42	627,800	36,048,276.00
210	688012	中微公司	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	156.45	72,300	11,311,335.00
211	688036	传音控股	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	147.00	212,100	31,178,700.00
212	000858	五 粮 液	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	163.57	25,500	4,171,035.00
213	688065	凯赛生物	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	62.26	7,400	460,724.00
214	688111	金山办公	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	472.22	161,000	76,027,420.00
215	688126	沪硅产业	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	20.90	13,400	280,060.00
216	688187	时代电气	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	41.86	26,700	1,117,662.00
217	688223	晶科能源	2023 年 7 月 10 日	14.06	10,800	151,848.00
218	688303	大全能源	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	40.45	8,500	343,825.00

219	688363	华熙生物	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	89.16	44,600	3,976,536.00
220	688396	华润微	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	52.41	23,900	1,252,599.00
221	688561	奇安信	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	51.81	15,400	797,874.00
222	688599	天合光能	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	42.61	90,600	3,860,466.00
223	000063	中兴通讯	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 24 日	45.54	2,778,100	126,514,674.00
224	000876	新 希 望	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	11.68	1,159,300	13,540,624.00
225	688981	中芯国际	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	50.52	15,500	783,060.00
226	000877	天山股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	8.14	588,800	4,792,832.00
227	000895	双汇发展	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	24.49	20,000	489,800.00
228	000938	紫光股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	31.85	446,400	14,217,840.00
229	000963	华东医药	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	43.37	14,700	637,539.00
230	000977	浪潮信息	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	48.50	756,600	36,695,100.00
231	000983	山西焦煤	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	9.10	508,400	4,626,440.00
232	001289	龙源电力	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	22.50	106,000	2,385,000.00
233	001979	招商蛇口	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	13.03	2,061,000	26,854,830.00
234	002001	新 和 成	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	15.40	29,400	452,760.00
235	000069	华侨城 A	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	4.40	300,700	1,323,080.00
236	002007	华兰生物	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	22.41	15,900	356,319.00
237	002027	分众传媒	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	6.81	64,300	437,883.00
238	002049	紫光国微	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 27 日	93.25	37,600	3,506,200.00
239	002050	三花智控	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	30.26	774,100	23,424,266.00
240	002064	华峰化学	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	6.86	440,800	3,023,888.00
241	002074	国轩高科	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	27.62	49,500	1,367,190.00
242	002120	韵达股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	9.56	541,300	5,174,828.00
243	002129	TCL 中环	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	33.20	251,700	8,356,440.00
244	002142	宁波银行	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	25.30	31,300	791,890.00
245	002179	中航光电	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	45.35	37,200	1,687,020.00
246	000100	TCL 科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 28 日	3.94	9,646,700	38,007,998.00
247	002180	纳思达	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	34.25	15,400	527,450.00
248	002202	金风科技	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	10.62	261,300	2,775,006.00
249	002230	科大讯飞	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 27 日	67.96	1,204,300	81,844,228.00
250	002236	大华股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	19.75	573,200	11,320,700.00
251	002241	歌尔股份	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	17.75	176,900	3,139,975.00
252	002252	上海莱士	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	7.51	35,400	265,854.00
253	002271	东方雨虹	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	27.26	20,800	567,008.00
254	002304	洋河股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	131.35	4,900	643,615.00
255	002311	海大集团	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	46.84	14,500	679,180.00
256	002352	顺丰控股	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	45.09	23,200	1,046,088.00
257	000157	中联重科	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	6.75	66,700	450,225.00
258	002371	北方华创	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	317.65	21,400	6,797,710.00
259	002410	广联达	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	32.49	17,200	558,828.00
260	002414	高德红外	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	7.77	137,400	1,067,598.00
261	002415	海康威视	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	33.11	35,200	1,165,472.00

262	002459	晶澳科技	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 10 日	41.70	98,900	4,124,130.00
263	002460	赣锋锂业	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 14 日	60.96	60,400	3,681,984.00
264	002466	天齐锂业	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	69.91	45,700	3,194,887.00
265	002475	立讯精密	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	32.45	36,800	1,194,160.00
266	002493	荣盛石化	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 14 日	11.64	536,800	6,248,352.00
267	002555	三七互娱	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	34.88	1,025,000	35,752,000.00
268	000166	申万宏源	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	4.62	58,400	269,808.00
269	002594	比亚迪	2023 年 7 月 10 日	258.27	4,900	1,265,523.00
270	002601	龙佰集团	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	16.50	948,000	15,642,000.00
271	002648	卫星化学	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	14.96	162,000	2,423,520.00
272	002709	天赐材料	2023 年 7 月 10 日	41.19	6,200	255,378.00
273	002714	牧原股份	2023 年 7 月 10 日	42.15	14,700	619,605.00
274	002736	国信证券	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	8.73	25,500	222,615.00
275	002756	永兴材料	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	62.61	208,300	13,041,663.00
276	002812	恩捷股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	96.35	500,900	48,261,715.00
277	002821	凯莱英	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	117.86	99,700	11,750,642.00
278	002841	视源股份	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	66.84	212,100	14,176,764.00
279	000301	东方盛虹	2023 年 7 月 10 日	11.82	14,200	167,844.00
280	002916	深南电路	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 14 日	75.37	7,100	535,127.00
281	002920	德赛西威	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	155.81	174,500	27,188,845.00
282	002938	鹏鼎控股	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	24.29	13,800	335,202.00
283	003816	中国广核	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 13 日	3.11	770,100	2,395,011.00
284	300014	亿纬锂能	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	60.50	487,100	29,469,550.00
285	300015	爱尔眼科	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	18.55	24,200	448,910.00
286	300033	同花顺	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	175.28	140,000	24,539,200.00
287	300059	东方财富	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	14.20	118,200	1,678,440.00
288	300122	智飞生物	2023 年 7 月 10 日	44.20	4,300	190,060.00
289	300124	汇川技术	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	64.21	15,000	963,150.00
290	000333	美的集团	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	58.92	36,400	2,144,688.00
291	300142	沃森生物	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	26.45	13,700	362,365.00
292	300207	欣旺达	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 25 日	16.32	481,000	7,849,920.00
293	300223	北京君正	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	88.31	130,400	11,515,624.00
294	300274	阳光电源	2023 年 7 月 10 日	116.63	7,100	828,073.00
295	300316	晶盛机电	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 13 日	70.90	216,100	15,321,490.00
296	300347	泰格医药	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 10 日	64.54	12,800	826,112.00
297	300408	三环集团	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	29.35	17,200	504,820.00
298	300413	芒果超媒	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	34.21	469,000	16,044,490.00
299	300433	蓝思科技	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	11.76	15,700	184,632.00
300	300450	先导智能	2023 年 7 月 10 日	36.17	5,900	213,403.00
合计	-	-	-	-	90,825,420	1,911,870,404.00

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

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的

分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	537,725,236.60	-	-	-	-	-	537,725,236.60
结算备付金	781,124,184.13	-	-	-	-	-	781,124,184.13
存出保证金	113,461,873.91	-	-	-	-	-	113,461,873.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	70,549,881,747.77	70,549,881,747.77
应收股利	-	-	-	-	-	834,531.59	834,531.59
应收清算款	-	-	-	-	-	21,031,027.60	21,031,027.60
其他资产	-	-	-	-	-	790,025.82	790,025.82
资产总计	1,432,311,294.64	-	-	-	-	70,572,537,332.78	72,004,848,627.42
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	286,554.44	286,554.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,742,079.11	28,742,079.11
应付托管费	-	-	-	-	-	5,748,415.81	5,748,415.81
应付清算款	-	-	-	-	-	53,378,198.85	53,378,198.85
应交税费	-	-	-	-	-	15.46	15.46
其他负债	-	-	-	-	-	46,187,964.43	46,187,964.43
负债总计	-	-	-	-	-	134,343,228.10	134,343,228.10
利率敏感度缺口	1,432,311,294.64	-	-	-	-	70,438,194,104.68	71,870,505,399.32
上年度末 2022 年 12 月	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

31 日							
资产							
银行存款	155,603,662.35	-	-	-	-	-	155,603,662.35
结算备付金	1,179,756,245.63	-	-	-	-	-	1,179,756,245.63
存出保证金	5,233,689.95	-	-	-	-	108,224,424.00	113,458,113.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	76,183,605,477.34	76,183,605,477.34
应收股利	-	-	-	-	-	329,237.44	329,237.44
应收清算款	-	-	-	-	-	2,829,488.24	2,829,488.24
其他资产	-	-	-	-	-	1,122,995.87	1,122,995.87
资产总计	1,340,593,597.93	-	-	-	-	76,296,111,622.89	77,636,705,220.82
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	30,652.12	30,652.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,555,976.07	30,555,976.07
应付托管费	-	-	-	-	-	6,111,195.25	6,111,195.25
应付清算款	-	-	-	-	-	53,830,041.48	53,830,041.48
应交税费	-	-	-	-	-	11.83	11.83
其他负债	-	-	-	-	-	43,674,118.72	43,674,118.72
负债总计	-	-	-	-	-	134,201,995.47	134,201,995.47
利率敏感度缺口	1,340,593,597.93	-	-	-	-	76,161,909,627.42	77,502,503,225.35

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 年 12 月 31 日：同)。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降

低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	70,549,881,747.77	98.16	76,183,605,477.34	98.30
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	-286,554.44	-0.00	-30,652.12	—
合计	70,549,595,193.33	98.16	76,183,574,825.22	98.30

注：其他包含：1、可退替代款。2、在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2023 年 6 月 30 日)	上年度末(2022 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	3,553,161,800.25	3,831,464,307.45
	沪深 300 指数下降 5%	-3,553,161,800.25	-3,831,464,307.45

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	70,546,690,708.22	76,181,672,587.51
第二层次	726,804.90	—
第三层次	2,464,234.65	1,932,889.83
合计	70,549,881,747.77	76,183,605,477.34

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 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	70,549,881,747.77	97.98
	其中：股票	70,549,881,747.77	97.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,318,849,420.73	1.83
8	其他各项资产	136,117,458.92	0.19
9	合计	72,004,848,627.42	100.00

注：1. 上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

2. 报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借股票的公允价值为 1,911,870,404.00 元，占本基金期末资产净值的 2.66%。其中，报告期内本基金与关联方进行转融通证券出借业务的证券 4,691,082 手，报告期末本基金与关联方进行转融通证券出借业务的余额为 724,762,909.00 元。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	791,275,663.65	1.10
B	采矿业	2,747,729,599.88	3.82
C	制造业	39,832,860,162.56	55.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,108,230,868.88	2.93
E	建筑业	1,674,141,898.15	2.33
F	批发和零售业	234,604,181.78	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	2,199,097,307.67	3.06
H	住宿和餐饮业	70,992,578.84	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,509,101,089.09	4.88

J	金融业	14,472,170,853.62	20.14
K	房地产业	1,059,751,978.84	1.47
L	租赁和商务服务业	660,972,661.99	0.92
M	科学研究和技术服务业	688,455,800.60	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	402,439,969.45	0.56
R	文化、体育和娱乐业	94,480,425.38	0.13
S	综合	—	—
	合计	70,546,305,040.38	98.16

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	3,274,028.05	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	83,928.25	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	119,783.56	0.00
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	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	3, 576, 707. 39	0. 00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2, 350, 037	3, 973, 912, 567. 00	5. 53
2	300750	宁德时代	9, 879, 754	2, 260, 388, 917. 66	3. 15
3	601318	中国平安	40, 621, 969	1, 884, 859, 361. 60	2. 62
4	600036	招商银行	46, 416, 689	1, 520, 610, 731. 64	2. 12
5	000858	五 粮 液	7, 290, 303	1, 192, 474, 861. 71	1. 66
6	000333	美的集团	18, 435, 853	1, 086, 240, 458. 76	1. 51
7	002594	比亚迪	3, 403, 351	878, 983, 462. 77	1. 22
8	601166	兴业银行	54, 434, 221	851, 895, 558. 65	1. 19
9	600900	长江电力	36, 699, 163	809, 583, 535. 78	1. 13
10	600276	恒瑞医药	16, 695, 514	799, 715, 120. 60	1. 11
11	600030	中信证券	36, 515, 185	722, 270, 359. 30	1. 00
12	601899	紫金矿业	61, 731, 029	701, 881, 799. 73	0. 98
13	600887	伊利股份	23, 868, 523	675, 956, 571. 36	0. 94
14	300059	东方财富	47, 456, 156	673, 877, 415. 20	0. 94
15	601012	隆基绿能	22, 743, 583	652, 058, 524. 61	0. 91
16	601398	工商银行	131, 099, 157	631, 897, 936. 74	0. 88
17	600309	万华化学	7, 051, 178	619, 375, 475. 52	0. 86
18	000651	格力电器	16, 884, 821	616, 464, 814. 71	0. 86
19	002475	立讯精密	18, 714, 529	607, 286, 466. 05	0. 84
20	601328	交通银行	102, 760, 702	596, 012, 071. 60	0. 83
21	002415	海康威视	17, 571, 652	581, 797, 397. 72	0. 81
22	000568	泸州老窖	2, 753, 535	577, 058, 329. 95	0. 80
23	000725	京东方 A	140, 231, 047	573, 544, 982. 23	0. 80
24	300760	迈瑞医疗	1, 819, 185	545, 391, 663. 00	0. 76
25	000063	中兴通讯	11, 947, 922	544, 108, 367. 88	0. 76
26	601816	京沪高铁	91, 967, 404	483, 748, 545. 04	0. 67
27	603259	药明康德	7, 672, 908	478, 098, 897. 48	0. 67
28	002230	科大讯飞	6, 941, 175	471, 722, 253. 00	0. 66
29	300274	阳光电源	3, 893, 823	454, 136, 576. 49	0. 63
30	600028	中国石化	71, 075, 830	452, 042, 278. 80	0. 63

31	601668	中国建筑	78,392,845	449,974,930.30	0.63
32	300124	汇川技术	6,966,798	447,338,099.58	0.62
33	002714	牧原股份	10,244,881	431,821,734.15	0.60
34	601288	农业银行	119,216,506	420,834,266.18	0.59
35	002352	顺丰控股	9,162,395	413,132,390.55	0.57
36	000001	平安银行	36,327,138	407,953,759.74	0.57
37	601888	中国中免	3,654,385	403,919,174.05	0.56
38	002129	TCL 中环	12,067,784	400,650,428.80	0.56
39	000792	盐湖股份	20,268,316	388,543,617.72	0.54
40	601088	中国神华	12,316,435	378,730,376.25	0.53
41	002142	宁波银行	14,777,420	373,868,726.00	0.52
42	601138	工业富联	14,794,188	372,813,537.60	0.52
43	688981	中芯国际	7,333,105	370,468,464.60	0.52
44	600031	三一重工	22,166,575	368,630,142.25	0.51
45	300498	温氏股份	19,588,770	359,453,929.50	0.50
46	000002	万科 A	25,433,925	356,583,628.50	0.50
47	600048	保利发展	26,923,193	350,809,204.79	0.49
48	600016	民生银行	92,945,417	348,545,313.75	0.48
49	600406	国电南瑞	15,029,186	347,174,196.60	0.48
50	600438	通威股份	10,079,452	345,825,998.12	0.48
51	600050	中国联通	71,526,201	343,325,764.80	0.48
52	600809	山西汾酒	1,828,656	338,429,365.92	0.47
53	601601	中国太保	12,828,840	333,293,263.20	0.46
54	600690	海尔智家	14,178,270	332,905,779.60	0.46
55	600837	海通证券	36,034,656	332,239,528.32	0.46
56	600436	片仔癀	1,151,310	329,689,131.60	0.46
57	601728	中国电信	57,957,751	326,302,138.13	0.45
58	600919	江苏银行	44,093,947	324,090,510.45	0.45
59	300015	爱尔眼科	17,433,507	323,391,554.85	0.45
60	600089	特变电工	14,492,863	323,045,916.27	0.45
61	688111	金山办公	683,104	322,575,370.88	0.45
62	600000	浦发银行	43,830,002	317,329,214.48	0.44
63	601857	中国石油	42,293,614	315,933,296.58	0.44
64	600941	中国移动	3,377,117	315,085,016.10	0.44
65	601988	中国银行	78,665,569	307,582,374.79	0.43
66	002371	北方华创	968,099	307,516,647.35	0.43
67	603501	韦尔股份	3,103,509	304,268,022.36	0.42
68	002304	洋河股份	2,253,512	295,998,801.20	0.41
69	601766	中国中车	45,380,009	294,970,058.50	0.41
70	603288	海天味业	6,249,078	292,769,304.30	0.41
71	601390	中国中铁	38,328,371	290,529,052.18	0.40
72	600905	三峡能源	53,543,200	287,526,984.00	0.40
73	300014	亿纬锂能	4,573,674	276,707,277.00	0.39

74	600150	中国船舶	8,342,000	274,535,220.00	0.38
75	000938	紫光股份	8,535,338	271,850,515.30	0.38
76	002466	天齐锂业	3,865,140	270,211,937.40	0.38
77	601688	华泰证券	19,220,905	264,671,861.85	0.37
78	603986	兆易创新	2,482,597	263,775,931.25	0.37
79	601225	陕西煤业	14,456,507	262,963,862.33	0.37
80	002027	分众传媒	37,746,474	257,053,487.94	0.36
81	002459	晶澳科技	6,151,060	256,499,202.00	0.36
82	002460	赣锋锂业	4,204,094	256,281,570.24	0.36
83	601169	北京银行	55,215,631	255,648,371.53	0.36
84	000338	潍柴动力	20,246,586	252,272,461.56	0.35
85	600570	恒生电子	5,686,425	251,851,763.25	0.35
86	688012	中微公司	1,597,687	249,958,131.15	0.35
87	601985	中国核电	35,199,340	248,155,347.00	0.35
88	600104	上汽集团	17,466,411	247,499,043.87	0.34
89	002050	三花智控	8,040,666	243,310,553.16	0.34
90	000625	长安汽车	18,522,914	239,501,278.02	0.33
91	002049	紫光国微	2,521,233	235,104,977.25	0.33
92	601211	国泰君安	16,792,980	234,933,790.20	0.33
93	600111	北方稀土	9,438,592	226,337,436.16	0.31
94	601919	中远海控	23,786,050	223,588,870.00	0.31
95	603019	中科曙光	4,357,075	221,775,117.50	0.31
96	000100	TCL 科技	56,084,930	220,974,624.20	0.31
97	603799	华友钴业	4,745,307	217,857,044.37	0.30
98	601628	中国人寿	6,209,333	217,078,281.68	0.30
99	600660	福耀玻璃	5,981,412	214,433,620.20	0.30
100	002179	中航光电	4,714,790	213,815,726.50	0.30
101	601229	上海银行	37,103,567	213,345,510.25	0.30
102	601818	光大银行	69,410,307	213,089,642.49	0.30
103	600585	海螺水泥	8,919,481	211,748,478.94	0.29
104	600009	上海机场	4,622,686	209,962,398.12	0.29
105	002812	恩捷股份	2,175,602	209,619,252.70	0.29
106	600893	航发动力	4,949,061	209,147,317.86	0.29
107	002271	东方雨虹	7,539,612	205,529,823.12	0.29
108	601989	中国重工	42,527,538	204,982,733.16	0.29
109	601658	邮储银行	41,435,900	202,621,551.00	0.28
110	002555	三七互娱	5,803,429	202,423,603.52	0.28
111	300122	智飞生物	4,486,639	198,309,443.80	0.28
112	600958	东方证券	19,534,552	189,485,154.40	0.26
113	600999	招商证券	13,857,300	188,043,561.00	0.26
114	000977	浪潮信息	3,852,712	186,856,532.00	0.26
115	600019	宝钢股份	33,219,945	186,696,090.90	0.26
116	600760	中航沈飞	4,095,087	184,278,915.00	0.26

117	002709	天赐材料	4,299,700	177,104,643.00	0.25
118	300896	爱美客	391,487	174,192,140.65	0.24
119	688036	传音控股	1,180,947	173,599,209.00	0.24
120	688599	天合光能	4,052,916	172,694,750.76	0.24
121	300316	晶盛机电	2,425,000	171,932,500.00	0.24
122	600426	华鲁恒升	5,565,707	170,477,605.41	0.24
123	601186	中国铁建	17,181,850	169,241,222.50	0.24
124	000661	长春高新	1,233,207	168,086,114.10	0.23
125	688008	澜起科技	2,921,642	167,760,683.64	0.23
126	601360	三六零	13,288,006	166,631,595.24	0.23
127	600584	长电科技	5,341,000	166,478,970.00	0.23
128	002920	德赛西威	1,064,026	165,785,891.06	0.23
129	601006	大秦铁路	22,189,833	164,870,459.19	0.23
130	601600	中国铝业	29,616,829	162,596,391.21	0.23
131	000776	广发证券	11,037,436	162,360,683.56	0.23
132	002410	广联达	4,934,468	160,320,865.32	0.22
133	300142	沃森生物	5,999,854	158,696,138.30	0.22
134	600745	闻泰科技	3,236,675	158,273,407.50	0.22
135	002241	歌尔股份	8,899,993	157,974,875.75	0.22
136	601377	兴业证券	25,795,625	157,869,225.00	0.22
137	600588	用友网络	7,700,894	157,868,327.00	0.22
138	600547	山东黄金	6,716,281	157,698,277.88	0.22
139	601939	建设银行	25,055,109	156,844,982.34	0.22
140	000166	申万宏源	33,662,000	155,518,440.00	0.22
141	601009	南京银行	19,334,033	154,672,264.00	0.22
142	600011	华能国际	16,403,829	151,899,456.54	0.21
143	600010	包钢股份	84,730,268	151,667,179.72	0.21
144	001979	招商蛇口	11,572,814	150,793,766.42	0.21
145	000596	古井贡酒	603,000	149,170,140.00	0.21
146	300450	先导智能	4,088,650	147,886,470.50	0.21
147	601669	中国电建	25,731,185	147,697,001.90	0.21
148	002311	海大集团	3,136,051	146,892,628.84	0.20
149	300408	三环集团	4,999,130	146,724,465.50	0.20
150	600085	同仁堂	2,537,547	146,061,205.32	0.20
151	600196	复星医药	4,718,825	145,811,692.50	0.20
152	601800	中国交建	13,292,900	145,025,539.00	0.20
153	603659	璞泰来	3,773,113	144,208,378.86	0.20
154	000963	华东医药	3,302,470	143,228,123.90	0.20
155	600886	国投电力	11,132,699	140,828,642.35	0.20
156	603993	洛阳钼业	26,360,243	140,500,095.19	0.20
157	000768	中航西飞	5,223,755	139,735,446.25	0.19
158	600600	青岛啤酒	1,345,865	139,471,989.95	0.19
159	600845	宝信软件	2,743,694	139,407,092.14	0.19

160	000538	云南白药	2,655,793	139,376,016.64	0.19
161	300033	同花顺	793,696	139,119,034.88	0.19
162	300782	卓胜微	1,391,047	134,416,871.61	0.19
163	601689	拓普集团	1,659,600	133,929,720.00	0.19
164	002252	上海莱士	17,628,395	132,389,246.45	0.18
165	000733	振华科技	1,380,338	132,305,397.30	0.18
166	002493	荣盛石化	11,364,901	132,287,447.64	0.18
167	600926	杭州银行	11,056,082	129,908,963.50	0.18
168	600015	华夏银行	23,770,526	128,598,545.66	0.18
169	601100	恒立液压	1,995,234	128,353,403.22	0.18
170	600795	国电电力	33,264,697	127,403,789.51	0.18
171	600176	中国巨石	8,957,884	126,843,637.44	0.18
172	300347	泰格医药	1,959,500	126,466,130.00	0.18
173	002180	纳思达	3,675,799	125,896,115.75	0.18
174	600674	川投能源	8,343,474	125,569,283.70	0.17
175	000157	中联重科	18,519,795	125,008,616.25	0.17
176	600732	爱旭股份	4,046,911	124,442,513.25	0.17
177	002236	大华股份	6,231,198	123,066,160.50	0.17
178	603369	今世缘	2,327,899	122,913,067.20	0.17
179	600029	南方航空	20,117,541	121,308,772.23	0.17
180	600115	中国东航	25,355,156	120,690,542.56	0.17
181	000425	徐工机械	17,719,543	119,961,306.11	0.17
182	300496	中科创达	1,221,177	117,660,403.95	0.16
183	601995	中金公司	3,302,621	117,309,097.92	0.16
184	601066	中信建投	4,815,498	116,535,051.60	0.16
185	601788	光大证券	7,319,224	116,302,469.36	0.16
186	601336	新华保险	3,148,752	115,779,611.04	0.16
187	000301	东方盛虹	9,782,869	115,633,511.58	0.16
188	601633	长城汽车	4,584,975	115,403,820.75	0.16
189	601117	中国化学	13,694,144	113,387,512.32	0.16
190	601868	中国能建	48,395,000	113,244,300.00	0.16
191	600346	恒力石化	7,886,739	113,016,969.87	0.16
192	601877	正泰电器	4,009,921	110,874,315.65	0.15
193	002074	国轩高科	3,984,694	110,057,248.28	0.15
194	002202	金风科技	10,294,614	109,328,800.68	0.15
195	600741	华域汽车	5,888,744	108,706,214.24	0.15
196	601111	中国国航	13,023,002	107,309,536.48	0.15
197	002001	新 和 成	6,885,971	106,043,953.40	0.15
198	601618	中国中冶	26,628,148	105,713,747.56	0.15
199	688126	沪硅产业	5,038,632	105,307,408.80	0.15
200	002841	视源股份	1,572,412	105,100,018.08	0.15
201	300454	深信服	919,726	104,158,969.50	0.14
202	002821	凯莱英	880,891	103,821,813.26	0.14

203	600989	宝丰能源	8,203,200	103,442,352.00	0.14
204	688223	晶科能源	7,355,996	103,425,303.76	0.14
205	600188	兖矿能源	3,450,910	103,251,227.20	0.14
206	603806	福斯特	2,752,213	102,354,801.47	0.14
207	601838	成都银行	8,351,611	101,973,170.31	0.14
208	688396	华润微	1,922,273	100,746,327.93	0.14
209	601901	方正证券	15,387,647	100,635,211.38	0.14
210	601615	明阳智能	5,938,131	100,235,651.28	0.14
211	000876	新希望	8,451,485	98,713,344.80	0.14
212	300661	圣邦股份	1,194,720	98,122,353.60	0.14
213	600460	士兰微	3,204,186	96,990,710.22	0.13
214	600039	四川路桥	9,788,219	96,022,428.39	0.13
215	000895	双汇发展	3,884,534	95,132,237.66	0.13
216	688303	大全能源	2,339,954	94,651,139.30	0.13
217	300413	芒果超媒	2,761,778	94,480,425.38	0.13
218	603392	万泰生物	1,408,675	94,057,229.75	0.13
219	002648	卫星化学	6,275,961	93,888,376.56	0.13
220	002736	国信证券	10,733,900	93,706,947.00	0.13
221	605117	德业股份	626,164	93,642,826.20	0.13
222	600233	圆通速递	6,407,500	93,293,200.00	0.13
223	000786	北新建材	3,792,511	92,954,444.61	0.13
224	603260	合盛硅业	1,319,912	92,420,238.24	0.13
225	002007	华兰生物	4,082,568	91,490,348.88	0.13
226	601607	上海医药	4,077,468	91,376,057.88	0.13
227	003816	中国广核	29,362,200	91,316,442.00	0.13
228	300207	欣旺达	5,465,649	89,199,391.68	0.12
229	002601	龙佰集团	5,376,845	88,717,942.50	0.12
230	300999	金龙鱼	2,217,200	88,665,828.00	0.12
231	300769	德方纳米	803,698	88,591,630.54	0.12
232	300433	蓝思科技	7,448,589	87,595,406.64	0.12
233	601238	广汽集团	8,259,520	86,064,198.40	0.12
234	601021	春秋航空	1,482,508	85,199,734.76	0.12
235	600383	金地集团	11,803,386	85,102,413.06	0.12
236	300759	康龙化成	2,191,504	83,890,773.12	0.12
237	300751	迈为股份	492,978	83,500,613.64	0.12
238	600332	白云山	2,599,152	82,860,965.76	0.12
239	600132	重庆啤酒	890,213	82,042,030.08	0.11
240	600219	南山铝业	26,208,730	79,150,364.60	0.11
241	600763	通策医疗	816,110	79,048,414.60	0.11
242	300223	北京君正	886,100	78,251,491.00	0.11
243	600875	东方电气	4,056,903	75,661,240.95	0.11
244	000983	山西焦煤	8,299,290	75,523,539.00	0.11
245	002756	永兴材料	1,196,833	74,933,714.13	0.10

246	300763	锦浪科技	714,700	74,400,270.00	0.10
247	600362	江西铜业	3,877,829	73,601,194.42	0.10
248	601865	福莱特	1,904,125	73,327,853.75	0.10
249	000723	美锦能源	9,702,015	73,153,193.10	0.10
250	601878	浙商证券	7,267,536	71,803,255.68	0.10
251	600918	中泰证券	10,388,200	71,782,462.00	0.10
252	601699	潞安环能	4,366,528	71,261,736.96	0.10
253	600754	锦江酒店	1,676,726	70,992,578.84	0.10
254	601319	中国人保	11,928,200	69,660,688.00	0.10
255	601872	招商轮船	11,946,304	69,169,100.16	0.10
256	601998	中信银行	11,461,466	68,539,566.68	0.10
257	600061	国投资本	9,609,144	68,417,105.28	0.10
258	000069	华侨城 A	15,335,929	67,478,087.60	0.09
259	000617	中油资本	9,250,979	66,884,578.17	0.09
260	300628	亿联网络	1,889,375	66,260,381.25	0.09
261	600803	新奥股份	3,490,300	66,245,894.00	0.09
262	603486	科沃斯	841,100	65,412,347.00	0.09
263	603290	斯达半导	303,711	65,358,607.20	0.09
264	000408	藏格矿业	2,864,800	64,658,536.00	0.09
265	600884	杉杉股份	4,216,262	63,834,206.68	0.09
266	300601	康泰生物	2,481,640	63,008,839.60	0.09
267	603899	晨光股份	1,407,839	62,845,932.96	0.09
268	603833	欧派家居	655,862	62,831,579.60	0.09
269	002938	鹏鼎控股	2,574,800	62,541,892.00	0.09
270	601799	星宇股份	500,592	61,873,171.20	0.09
271	600183	生益科技	4,354,400	61,832,480.00	0.09
272	688005	容百科技	1,130,805	61,086,086.10	0.08
273	688363	华熙生物	672,254	59,938,166.64	0.08
274	000708	中信特钢	3,777,144	59,829,960.96	0.08
275	300919	中伟股份	958,822	57,769,025.50	0.08
276	601898	中煤能源	6,799,159	57,384,901.96	0.08
277	601881	中国银河	4,780,152	55,497,564.72	0.08
278	600018	上港集团	10,441,642	54,818,620.50	0.08
279	002916	深南电路	724,721	54,622,221.77	0.08
280	603185	上机数控	719,525	53,640,588.75	0.07
281	002120	韵达股份	5,439,868	52,005,138.08	0.07
282	601216	君正集团	12,573,209	51,550,156.90	0.07
283	002064	华峰化学	7,432,995	50,990,345.70	0.07
284	000877	天山股份	6,259,000	50,948,260.00	0.07
285	688561	奇安信	982,686	50,912,961.66	0.07
286	002414	高德红外	6,343,505	49,289,033.85	0.07
287	601155	新城控股	3,399,367	48,984,878.47	0.07
288	600025	华能水电	6,690,300	47,701,839.00	0.07

289	600606	绿地控股	15,747,696	43,306,164.00	0.06
290	603195	公牛集团	424,575	40,784,674.50	0.06
291	688065	凯赛生物	642,655	40,011,700.30	0.06
292	300957	贝泰妮	446,200	39,658,256.00	0.06
293	688187	时代电气	921,237	38,562,980.82	0.05
294	601698	中国卫通	1,593,600	31,680,768.00	0.04
295	601808	中海油服	2,201,600	30,558,208.00	0.04
296	000800	一汽解放	3,493,300	29,238,921.00	0.04
297	605499	东鹏饮料	154,500	26,713,050.00	0.04
298	601236	红塔证券	3,540,110	26,373,819.50	0.04
299	300979	华利集团	520,909	25,389,104.66	0.04
300	001289	龙源电力	533,318	11,999,655.00	0.02

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688515	裕太微	4,183	680,783.25	0.00
2	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.00
3	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.00
4	688522	纳睿雷达	4,299	221,398.50	0.00
5	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
6	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
7	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
8	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
9	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
10	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
11	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
12	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
13	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
14	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
15	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
16	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
17	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
18	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
19	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
20	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
21	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
22	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
23	688352	顾中科技	2,361	28,497.27	0.00
24	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
25	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
26	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00

27	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
28	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
29	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
30	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
31	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
32	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
33	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
34	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
35	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
36	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
37	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
38	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
39	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
40	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
41	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
42	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
43	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
44	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
45	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
46	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
47	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
48	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
49	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
50	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
51	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
52	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
53	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
54	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
55	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
56	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
57	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
58	301360	荣旗科技	111	10,278.60	0.00
59	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
60	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
61	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
62	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
63	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
64	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
65	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
66	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
67	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
68	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
69	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00

70	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
71	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
72	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
73	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
74	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
75	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
76	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
77	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
78	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
79	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
80	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
81	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
82	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
83	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
84	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
85	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
86	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	1,384,752,799.98	1.79
2	000858	五粮液	851,525,529.46	1.10
3	002594	比亚迪	605,925,142.36	0.78
4	000333	美的集团	551,285,573.27	0.71
5	300059	东方财富	505,920,885.36	0.65
6	002415	海康威视	367,544,364.04	0.47
7	300760	迈瑞医疗	358,209,708.35	0.46
8	000651	格力电器	322,398,634.71	0.42
9	000725	京东方 A	310,921,331.42	0.40
10	002352	顺丰控股	304,355,962.96	0.39
11	000568	泸州老窖	294,986,889.64	0.38
12	002475	立讯精密	293,060,196.75	0.38
13	002714	牧原股份	265,017,835.78	0.34
14	000001	平安银行	263,448,690.74	0.34
15	300274	阳光电源	253,476,393.04	0.33
16	000792	盐湖股份	242,919,489.49	0.31
17	300015	爱尔眼科	236,016,490.19	0.30
18	000002	万科 A	232,709,229.98	0.30
19	002129	TCL 中环	228,681,164.65	0.30

20	300124	汇川技术	227,401,766.58	0.29
----	--------	------	----------------	------

注：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	1,620,298,806.44	2.09
2	000858	五粮液	1,017,980,487.09	1.31
3	002594	比亚迪	708,537,130.69	0.91
4	000333	美的集团	622,671,721.63	0.80
5	300059	东方财富	596,889,012.41	0.77
6	002415	海康威视	442,269,715.23	0.57
7	300760	迈瑞医疗	413,473,273.10	0.53
8	000651	格力电器	380,054,983.44	0.49
9	000725	京东方 A	367,602,372.93	0.47
10	002352	顺丰控股	357,845,452.94	0.46
11	000568	泸州老窖	354,092,835.05	0.46
12	002475	立讯精密	349,758,678.77	0.45
13	000001	平安银行	315,675,613.54	0.41
14	002714	牧原股份	305,227,815.91	0.39
15	000792	盐湖股份	298,732,554.88	0.39
16	300274	阳光电源	297,377,794.48	0.38
17	300124	汇川技术	288,497,251.66	0.37
18	000002	万科 A	283,730,417.85	0.37
19	300015	爱尔眼科	283,059,554.11	0.37
20	002142	宁波银行	279,208,120.74	0.36

注：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	18,891,241,183.44
卖出股票收入（成交）总额	21,788,462,125.76

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本报告期末投资的前十名证券中，招商银行（600036）于 2022 年 8 月 31 日收到中国人民银行下发的银罚决字[2022]1 号，因违反国库管理规定，违反征信管理规定，违反清算管理规定，违反支付结算管理规定，违反账户管理规定，违反银行结算账户业务规定，未按规定履行客户身份识别义务，未按规定报送大额交易或者可疑交易报告，其他违规行为，对招商银行处以没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3423.5 万元的处罚。同时银保监会于 2022 年 9 月 9 日下发银保监罚决字[2022]48 号，罚款 460 万元。对该证券投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，上述证券系标的指数成份股，上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

兴业银行（601166）于 2022 年 9 月 9 日及 2022 年 9 月 28 日受到银保监会的处罚，因违反审慎经营规则及存款业务违规，违规办理同业业务，内部管理与控制制度不健全或执行监督不力，故分别罚款 150 万元和 450 万元。对该证券投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，上述证券系标的指数成份股，上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除此之外，报告期内基金投资的其他前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有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是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

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	113,461,873.91
2	应收清算款	21,031,027.60
3	应收股利	834,531.59
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	790,025.82
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	136,117,458.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600519	贵州茅台	5,749,400.00	0.01	转融通证券出借
2	000858	五粮液	4,171,035.00	0.01	转融通证券出借
3	600036	招商银行	3,639,636.00	0.01	转融通证券出借
4	300750	宁德时代	3,248,818.00	0.00	转融通证券出借
5	601318	中国平安	3,164,480.00	0.00	转融通证券出借
6	600900	长江电力	2,391,304.00	0.00	转融通证券出借
7	000333	美的集团	2,144,688.00	0.00	转融通证券出借
8	600276	恒瑞医药	1,623,810.00	0.00	转融通证券出借
9	601166	兴业银行	1,378,765.00	0.00	转融通证券出借
10	002594	比亚迪	1,265,523.00	0.00	转融通证券出借

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688515	裕太微	680,783.25	0.00	新股锁定期内
2	301486	致尚科技	277,921.20	0.00	新股未上市
3	688522	纳睿雷达	221,398.50	0.00	新股锁定期内

4	688249	晶合集成	133,734.30	0.00	新股锁定期内
5	301291	明阳电气	37,422.18	0.00	新股锁定期内

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		华泰柏瑞沪深 300 交 易型开放式指数证券 投资基金联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
475,296	38,968.53	11,503,431,607.00	62.11	6,415,514,018.00	34.64	602,642,065.00	3.25

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	中央汇金投资有限责任公司	2,423,958,601.00	13.09
2	国泰君安证券股份有限公司	753,341,354.00	4.07
3	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	540,376,700.00	2.92
4	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	512,691,500.00	2.77
5	友邦人寿保险有限公司—传统	256,590,000.00	1.39
6	中国人寿再保险股份有限公司	221,659,699.00	1.20
7	招商局仁和人寿保险股份有限公司—传统产品 3 号	182,244,400.00	0.98
8	民生证券有限责任公司	182,159,800.00	0.98
9	GIC PRIVATE LIMITED	167,883,055.00	0.91
10	申万宏源证券有限公司	151,618,200.00	0.82

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	10,000.00	0.0001

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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（2012 年 5 月 4 日）基金份额总额	32,968,633,875.00
本报告期期初基金份额总额	19,691,587,690.00
本报告期基金总申购份额	9,852,300,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	11,022,300,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	18,521,587,690.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人的重大人事变动：

2023 年 4 月 18 日，经公司董事会批准董元星先生不再担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

注：报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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 (%)	
广发证券	4	24,514,130,104.31	60.29	3,368,077.12	50.44	-
招商证券	2	10,047,829,996.67	24.71	1,419,796.56	21.26	-
中信建投	2	4,783,231,907.50	11.76	675,884.30	10.12	-
华宝证券	1	1,317,776,639.27	3.24	1,214,070.88	18.18	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：1、公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	17,268,668.08	80.22	-	-	-	-
华宝证	4,257,356.4	19.78	-	-	-	-

券	4					
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-

券						
中信证 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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 21 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 6 月 16 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 29 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 19 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 4 月 11 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司修订基金投顾服务协议、业务规则与风险揭示书的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 30 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 22 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 3 月 21 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 2 月 23 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 2 月 15 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 1 月 17 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 1 月 13 日
13	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证监会规定报刊和网站	2023 年 1 月 9 日

§ 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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日