

兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证 券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 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	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	20
§ 7 投资组合报告	125
7.1 期末基金资产组合情况	125
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	126
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	128
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	131
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	133

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	133
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	133
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	133
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	133
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	133
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	134
7.12 投资组合报告附注	134
§ 8 基金份额持有人信息	135
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	135
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	136
8.3 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	136
§ 9 开放式基金份额变动	136
§ 10 重大事件揭示	137
10.1 基金份额持有人大会决议	137
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	137
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	137
10.4 基金投资策略的改变	137
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	137
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	137
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	138
10.8 其他重大事件	140
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	141
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	141
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	141
§ 12 备查文件目录	142
12.1 备查文件目录	142
12.2 存放地点	142
12.3 查阅方式	142

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金	
基金简称	兴全中证 800 六个月持有指数	
基金主代码	010673	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 9 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,588,207,584.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全中证 800 六个月持有指数 A	兴全中证 800 六个月持有指数 C
下属分级基金的交易代码	010673	010674
报告期末下属分级基金的份额总额	1,430,403,745.60 份	157,803,838.64 份

注：本基金每份基金份额最短持有期为 6 个月。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 800 指数进行有效跟踪的基础上，对基金投资组合进行相对增强，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪中证 800 指数，并在严格控制与业绩比较基准偏离风险的前提下进行相对增强的组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×90%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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		兴证全球基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084

电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95555
传真	021-20398858	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	201204	518040
法定代表人	杨华辉	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼

§ 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	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
和指标	兴全中证 800 六个月持有指数 A	兴全中证 800 六个月持有指数 C
本期已实现收益	19,202,784.09	1,790,701.61
本期利润	-96,645,546.44	-11,485,955.04
加权平均基金份 额本期利润	-0.0648	-0.0697
本期加权平均净 值利润率	-6.91%	-7.45%
本期基金份额净 值增长率	-6.32%	-6.51%
3.1.2 期末数据	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利 润	-55,015,856.62	-6,910,803.06

期末可供分配基金份额利润	-0.0385	-0.0438
期末基金资产净值	1,375,387,888.98	150,893,035.58
期末基金份额净值	0.9615	0.9562
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-3.85%	-4.38%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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

3、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（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

兴全中证 800 六个月持有指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.98%	0.85%	8.24%	1.00%	0.74%	-0.15%
过去三个月	4.34%	1.34%	4.98%	1.39%	-0.64%	-0.05%
过去六个月	-6.32%	1.39%	-9.01%	1.39%	2.69%	0.00%
过去一年	-4.43%	1.13%	-11.95%	1.15%	7.52%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-3.85%	0.97%	-14.54%	1.14%	10.69%	-0.17%

兴全中证 800 六个月持有指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.94%	0.84%	8.24%	1.00%	0.70%	-0.16%
过去三个月	4.23%	1.34%	4.98%	1.39%	-0.75%	-0.05%
过去六个月	-6.51%	1.39%	-9.01%	1.39%	2.50%	0.00%
过去一年	-4.81%	1.13%	-11.95%	1.15%	7.14%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-4.38%	0.97%	-14.54%	1.14%	10.16%	-0.17%

注：本基金为指数增强型证券投资基金，标的指数是中证 800 指数，本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

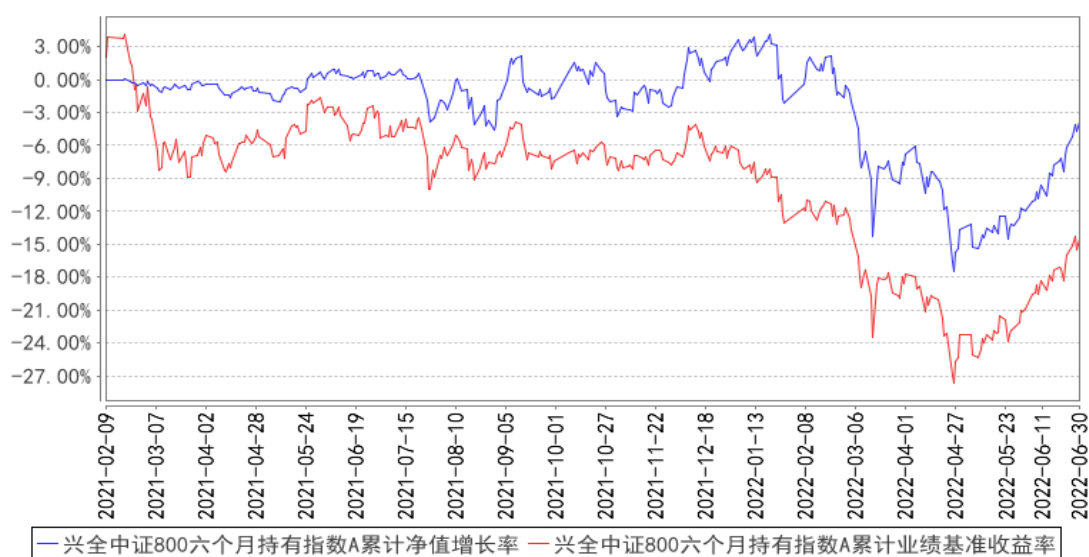
$$\text{Return}_t = 90\% \times (\text{中证 800 指数收益率}_t / \text{中证 800 指数收益率}_{t-1} - 1) + 5\% (\text{恒生指数收益率}_t / \text{恒生指数收益率}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{银行活期存款利率}_t / 360)$$

$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

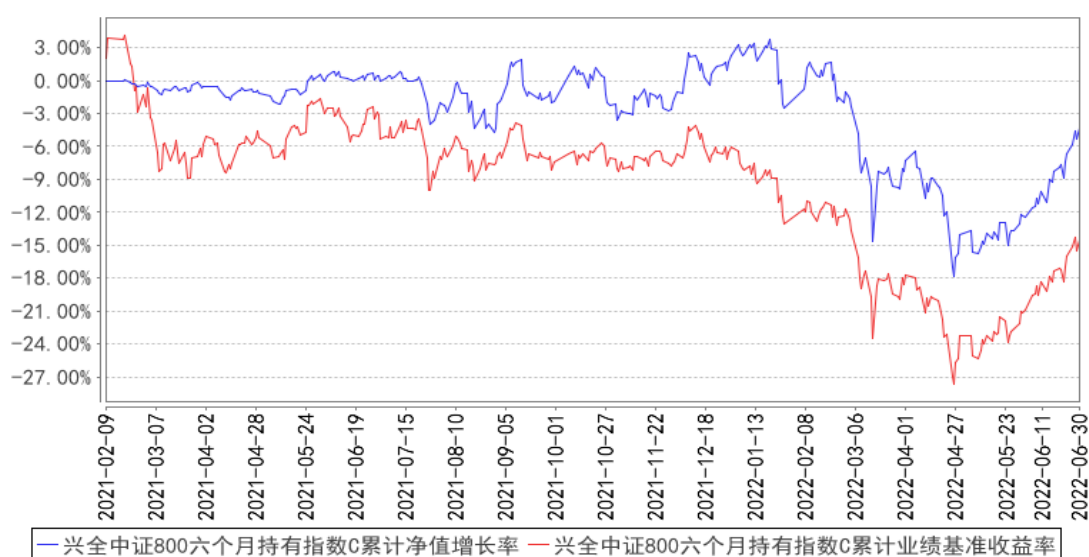
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

兴全中证800六个月持有指数A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



兴全中证800六个月持有指数C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：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2021 年 2 月 9 日至 2021 年 8 月 8 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例将符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月，中国证监会批复（证监许可[2008]6 号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008 年 4 月 9 日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由 9800 万元变更为人民币 1.2 亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。2008 年 7 月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号），公司于 2008 年 8 月 25 日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”，注册资本增加为 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016 年 12 月 28 日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020 年 3 月 18 日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截止 2022 年 6 月 30 日，公司旗下共 50 只基金，品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、FOF 等不同类型，建立了覆盖高中低等级的公募基金产品线，为各类风险偏好的投资者提供便捷、专业的投资理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申庆	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理	2021 年 2 月 9 日	-	25 年	硕士，历任兴业证券研究发展中心研究员，兴证全球基金管理有限公司行业研究员，兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、基金管理部总监助理、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理。
张晓峰	兴全中证 800 六个月持有期指数增强	2021 年 5 月 24 日	-	11 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司 FOF 投资与金融工程部研究员、固定收益部研究员、兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理助理、兴全沪

	型证券投资基金基金经理				深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理。
--	-------------	--	--	--	---------------------------------

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

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：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

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循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

上半年在国内外各种超预期事件的影响下，市场走出了以 4 月底为分水岭的 V 型走势，前后风格差异较大。年初，在长达三年的慢牛行情后，市场主流观点逐渐走向谨慎，使得某种被高度期待的季节效应并未发生。随后海外地缘事件和国内疫情反复，市场风险偏好急剧下降，成长赛

道类资产回撤较大，低估值红利类资产表现出较强的防御性。不过随着疫情缓和、资金面持续宽松以及对冲性政策陆续落地，市场风险偏好重新上升，开始交易复苏逻辑，高景气赛道资产以及中小市值专精特新资产在二季度大部分时候都能跑赢低估值红利类资产。

目前看市场处于相对均衡的存量博弈状态。一方面上半年市场的剧烈波动影响居民风险偏好，使得居民资产再配置的节奏可能受到一定扰动，行为模式上可能更倾向于高抛低吸，市场更难出现正反馈式的单边行情；另一方面目前相对宽松的流动性环境和不断降低的无风险收益率有助于提升权益资产的相对吸引力，风险溢价有望降低。

在具体操作上，我们依然坚持在保持总体行业和风格均衡前提下的行业内相对综合价值比较的选股策略，并积极把握各种确定性的超额收益甚至绝对收益。一方面偏向价值的投资组合在类似一季度的逆风中防御性相对较强，另一方面通过更具性价比的方式对“赛道”类资产进行配置。在相对均衡的环境下，市场上不同投资目标的参与者（绝对收益 vs 相对收益）也很容易交易出偏离合理估值的价格，有助于指数增强策略发掘相对收益交易机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全中证 800 六个月持有指数 A 的基金份额净值为 0.9615 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.32%，同期业绩比较基准收益率为-9.01%；截至本报告期末兴全中证 800 六个月持有指数 C 的基金份额净值为 0.9562 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.51%，同期业绩比较基准收益率为-9.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年随着海内外不确定性因素不断涌现，国内政策取向日益多元化，投资者需要站在更高的视角，从价值理性的角度思考问题，而不能冒着过度简化的风险，仅基于工具理性进行推断。上半年疫情冲击弱于 2020 年，体现了经济的韧性，也为 5 月以来的复苏交易奠定良好基础。展望下半年，复苏持续性面临不确定性。随着海外衰退预期上升，货币政策不断收紧，外需存在走弱的风险，需要通过扩大内需加以对冲。考虑到地产不确定性较高，基建有望起到更大的托底作用。

目前市场面临的问题是上市公司盈利短期下行压力和流动性宽松下市场风险偏好上升之间的矛盾。虽然从宏观数据看，本轮疫情对经济的冲击弱于 2020 年初，复苏也更早启动，但从规模以上工业企业盈利看，仍会对二季度上市公司盈利产生一定负面影响。处于转型期的传统经济引擎面临的挑战，也将给相关产业链下半年的盈利带来不确定性。在其他因素保持平稳的假设下，市场表现将取决于盈利预期和风险偏好之间的消长。从居民财富配置的角度看，虽然市场波动对其入市节奏有所扰动，但我们相信随着经济复苏，居民资产再配置仍将是长期的趋势，有望给市场带来长期稳定资金。

我们坚持之前的判断，历史上任何时期的情绪化高估值品种都会向合理水平回归。从近年来的观察看，选股范式如走马灯一般频繁更换，有效因子经历了从价值、质量到景气度的转变。下一阶段的市场选股范式会发生何种变化，我们无法预判，但“变化”本身是确定的，一旦市场出现某些简单有效的选股因子，往往也意味着某类风格走向极致，本身就意味着风险的集聚。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	106,833.10	509,792.95
结算备付金		1,842,909.35	3,114,250.36
存出保证金		66,174.75	362,019.26
交易性金融资产	6.4.7.2	1,615,041,441.47	1,950,223,244.87
其中：股票投资		1,473,715,403.50	1,832,300,496.37
基金投资		—	—
债券投资		141,326,037.97	117,922,748.50
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	14,500,000.00	—
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		5,968,595.42	37,024,528.99
应收股利		—	—

应收申购款		109,523.15	27,478.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	35,198.29	1,381,863.57
资产总计		1,637,670,675.53	1,992,643,178.01
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		83,117,963.57	70,112,589.43
应付清算款		2,490,538.99	5.17
应付赎回款		23,718,503.99	13,559,673.81
应付管理人报酬		1,332,676.87	1,850,381.85
应付托管费		181,728.67	252,324.85
应付销售服务费		47,272.90	69,095.39
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,006.89	8,407.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	496,059.09	655,646.89
负债合计		111,389,750.97	86,508,125.17
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,588,207,584.24	1,857,684,582.36
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-61,926,659.68	48,450,470.48
净资产合计		1,526,280,924.56	1,906,135,052.84
负债和净资产总计		1,637,670,675.53	1,992,643,178.01

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，兴全中证 800 六个月持有指数 A 基金份额净值 0.9615 元，基金份额总额 1,430,403,745.60 份；兴全中证 800 六个月持有指数 C 基金份额净值 0.9562 元，基金份额总额 157,803,838.64 份。兴全中证 800 六个月持有指数份额总额合计为 1,588,207,584.24 份。

2、以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-97,164,049.89	32,565,871.37
1. 利息收入		927,752.32	15,601,658.77
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,660.53	801,806.87
债券利息收入		-	4,298,355.63
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		226.83	10,501,496.27
证券出借利息收入		906,864.96	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）		30,912,612.21	17,637,124.34
其中：股票投资收益	6.4.7.14	12,124,547.17	7,674,965.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,316,347.82	-78,966.54
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	17,471,717.22	10,041,125.42
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	-129,124,987.18	-672,911.74
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	120,572.76	-
减：二、营业总支出		10,967,451.59	15,598,980.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,495,972.41	12,175,874.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,158,541.67	1,660,346.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	306,679.16	576,398.01
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		759,261.76	-
其中：卖出回购金融资产支 出		759,261.76	-

6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		3, 359. 42	8. 77
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	243, 637. 17	1, 186, 352. 55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-108, 131, 501. 48	16, 966, 890. 97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-108, 131, 501. 48	16, 966, 890. 97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-108, 131, 501. 48	16, 966, 890. 97

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	1, 857, 684, 582. 36	-	48, 450, 470. 48	1, 906, 135, 052. 84
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)	1, 857, 684, 582. 36	-	48, 450, 470. 48	1, 906, 135, 052. 84
三、本期增减变动额(减少以“-”	-269, 476, 998. 12	-	-110, 377, 130. 16	-379, 854, 128. 28

号填列)				
(一)、 综合收益总额	-	-	-108,131,501.48	-108,131,501.48
(二)、 本期基金份额 交易产生的基 金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)	-269,476,998.12	-	-2,245,628.68	-271,722,626.80
其中:1. 基金申购款	46,526,679.53	-	-4,263,198.10	42,263,481.43
2. 基金赎回款	-316,003,677.65	-	2,017,569.42	-313,986,108.23
(三)、 本期向基金份 额持有人分配 利润产生的基 金净值变动(净 值减少以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资产(基 金净值)	1,588,207,584.24	-	-61,926,659.68	1,526,280,924.56
项目	上年度可比期间			
	2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 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)	-	-	-	-
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)	2,877,155,099.67	-	-	2,877,155,099.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5,515,660.22	-	16,949,786.88	22,465,447.10
(一)、综合收益总额	-	-	16,966,890.97	16,966,890.97
(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)	5,515,660.22	-	-17,104.09	5,498,556.13
其中:1.基金申购款	5,515,660.22	-	-17,104.09	5,498,556.13
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)				
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	2,882,670,759.89	-	16,949,786.88	2,899,620,546.77

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：

杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会证监许可【2020】2894 号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集基金份额 2,876,741,976.79 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了验资报告。本基金基金合同于 2021 年 2 月 9 日正式生效。本基金的管理人为兴证全球基金管理有限公司，托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 800 指数的成份股及其备选成份股、其他非指数成分股（包含主板、中小板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、港股通标的股票）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票

据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%,投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准:中证 800 指数收益率 $\times$ 90%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算) $\times$ 5%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021 年的比较数据将不作重述。

金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项,本基金运用简化计量方法,按照相当于整个存续期内的预期

信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

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

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

(8) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0 元。

本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、卖出回购金融资产款、应付利息、应付交易费用和其他负债，金额分别为人民币 509,792.95 元、人民币 3,114,250.36 元、人民币 362,019.26 元、人民币 1,381,863.57 元、人民币 70,112,589.43 元、人民币 39,481.87 元、人民币 337,477.36 元和人民币 170,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、买入返售金融资产和其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证

金、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款和其他负债的金额分别为人民币 509,969.8 元、人民币 3,115,791.9 元、人民币 362,198.45 元、人民币-106.39 元、人民币 70,152,071.3 元、人民币 507,477.36 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 1,950,223,244.87 元，属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 1,339,206.33 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 1,951,562,451.2 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

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

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	106,833.10
等于：本金	106,800.54
加：应计利息	32.56
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	106,833.10
----	------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,582,818,916.71	-	1,473,715,403.50	-109,103,513.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	66,535,578.31	349,574.43	70,386,405.09	3,501,252.35
	银行间市场	70,096,572.50	873,632.88	70,939,632.88	-30,572.50
	合计	136,632,150.81	1,223,207.31	141,326,037.97	3,470,679.85
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,719,451,067.52	1,223,207.31	1,615,041,441.47	-105,632,833.36

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	14,500,000.00	-

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通过买断式逆回购交易取得债券。

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

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本报告期末本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

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：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	—
其他应收款	35,198.29
待摊费用	—
合计	35,198.29

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—

应付赎回费	42,058.15
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	47,920.64
其中：交易所市场	43,264.12
银行间市场	4,656.52
应付利息	-
预提审计费用	29,752.78
预提信息披露费	169,507.37
应付指数使用费	206,820.15
合计	496,059.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴全中证 800 六个月持有指数 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,670,491,950.92	1,670,491,950.92
本期申购	44,177,880.08	44,177,880.08
本期赎回（以“-”号填列）	-284,266,085.40	-284,266,085.40
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,430,403,745.60	1,430,403,745.60

兴全中证 800 六个月持有指数 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	187,192,631.44	187,192,631.44
本期申购	2,348,799.45	2,348,799.45
本期赎回（以“-”号填列）	-31,737,592.25	-31,737,592.25
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	157,803,838.64	157,803,838.64

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

兴全中证 800 六个月持有指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	14,821,775.07	29,362,342.17	44,184,117.24
本期利润	19,202,784.09	-115,848,330.53	-96,645,546.44
本期基金份额交易产生的变动数	-2,839,409.65	284,982.23	-2,554,427.42
其中：基金申购款	503,195.77	-4,595,410.28	-4,092,214.51
基金赎回款	-3,342,605.42	4,880,392.51	1,537,787.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,185,149.51	-86,201,006.13	-55,015,856.62

兴全中证 800 六个月持有指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	995,444.36	3,270,908.88	4,266,353.24
本期利润	1,790,701.61	-13,276,656.65	-11,485,955.04
本期基金份额交易产生的变动数	-210,030.69	518,829.43	308,798.74
其中：基金申购款	16,750.70	-187,734.29	-170,983.59
基金赎回款	-226,781.39	706,563.72	479,782.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,576,115.28	-9,486,918.34	-6,910,803.06

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,100.95
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	17,162.98
其他	2,396.60
合计	20,660.53

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,124,547.17
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	12,124,547.17
----	---------------

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	342,748,013.99
减：卖出股票成本总额	329,912,401.21
减：交易费用	711,065.61
买卖股票差价收入	12,124,547.17

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借投资收益。

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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,230,390.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	85,957.47
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	1,316,347.82

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	82,593,027.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	80,821,958.66
减：应计利息总额	1,683,329.10
减：交易费用	1,782.06
买卖债券差价收入	85,957.47

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

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：无。

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：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

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：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

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：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	17,471,717.22
其中：证券出借权益补偿收入	984,426.94
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,471,717.22

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-129,124,987.18
股票投资	-130,129,929.89
债券投资	1,004,942.71
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-129,124,987.18

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	120,002.84
基金转换费收入	569.92
合计	120,572.76

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	18,000.00
银行费用	12,199.25
指数使用费	123,577.77
其他费用	600.00
合计	243,637.17

6.4.7.24 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明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

本报告期内与本基金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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 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 （%）
兴业证券	196,994,223.47	57.31	807,337,163.22	92.68

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）
兴业证券	11,108,532.60	17.72	475,679,197.10	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
兴业证券	475,500,000.00	21.34	17,745,144,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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（%）
兴业证券	183,459.80	64.74	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 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（%）
兴业证券	752,872.68	94.61	159,612.75	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券

结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,495,972.41	12,175,874.54
其中：支付销售机构的客户维护费	3,122,606.58	4,487,674.37

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.1%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.1%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,158,541.67	1,660,346.53

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全中证 800 六个月持有指数 A	兴全中证 800 六个月持有指数 C	合计
兴业证券	—	33,067.38	33,067.38
兴证全球基金	—	7,024.28	7,024.28
招商银行	—	49,842.66	49,842.66
合计	—	89,934.32	89,934.32
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全中证 800 六个月持有指数 A	兴全中证 800 六个月持有指数 C	合计
兴证全球基金	—	9,002.71	9,002.71
招商银行	—	68,991.47	68,991.47
兴业证券	—	56,987.34	56,987.34
合计	—	134,981.52	134,981.52

注：本报告期内本基金的 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 年销售服务费率 / 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：本基金本报告期末与关联方进行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

注：本基金本报告期内无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。

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 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
兴业证券股份有限公司	2022010400005045	科伦药业	2022 年 1 月 4 日	2,146,160.00	111,200	14	1.70	1,418.85	—	—
兴业证券股份有限公司	2022010400005051	陕西煤业	2022 年 1 月 4 日	1,845,408.00	150,400	14	1.70	1,220.02	—	—
兴业证券股份有限公司	2022010400005053	东软集团	2022 年 1 月 4 日	2,540,538.00	183,300	14	1.70	1,679.58	—	—
兴业证券股份有限公司	2022010400005055	贵阳银行	2022 年 1 月 4 日	334,560.00	51,000	14	1.70	221.18	—	—

兴业证券股份有限公司	2022010400005057	上海机场	2022 年 1 月 4 日	1,746,720.00	36,000	14	1.70	1,154.78	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010400005059	三七互娱	2022 年 1 月 4 日	2,142,215.00	76,100	14	1.70	1,416.24	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010400020901	亚光科技	2022 年 1 月 4 日	1,643,400.00	180,000	14	3.40	2,172.94	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500001683	三花智控	2022 年 1 月 5 日	994,800.00	40,000	14	1.70	657.67	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500001933	通威股份	2022 年 1 月 5 日	834,600.00	20,000	14	1.70	551.76	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500002024	东软集团	2022 年 1 月 5 日	3,081,414.00	230,300	14	1.70	2,037.16	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500007217	泸州老窖	2022 年 1 月 5 日	2,478,700.00	10,000	14	1.70	1,638.70	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500007465	川投能源	2022 年 1 月 5 日	1,449,600.00	120,000	14	1.70	958.35	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500007467	上海医药	2022 年 1 月 5 日	402,600.00	20,000	14	1.70	266.16	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500008395	巨人网络	2022 年 1 月 5 日	656,500.00	50,000	14	1.70	434.02	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500008397	云海金属	2022 年 1 月 5 日	5,371,190.00	253,000	14	1.70	3,550.95	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500008399	万达电影	2022 年 1 月 5 日	423,232.00	27,200	14	1.70	279.80	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500011463	芒果超媒	2022 年 1 月 5 日	1,060,290.00	18,900	14	3.20	1,319.47	-	-
兴业证券股份有限公司	2022010500011465	碧水源	2022 年 1 月 5 日	2,082,025.00	282,500	14	3.20	2,590.96	-	-
兴业证券股份有限公司	202201060000	中国神华	2022 年 1 月 6 日	617,716.00	27,800	14	1.70	408.38	-	-

	5643									
兴业证券股份 有限公司	202201 060000 5645	重庆百 货	2022 年 1 月 6 日	1,286,55 0.00	45,000	14	1.70	850.55	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 060000 5647	金 融 街	2022 年 1 月 6 日	326,600. 00	56,800	14	1.70	215.92	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 060000 5649	安迪苏	2022 年 1 月 6 日	590,944. 00	47,200	14	1.70	390.68	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 060000 5651	康弘药 业	2022 年 1 月 6 日	5,326,03 2.00	256,800	14	1.70	3,521. 10	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 6893	徐工机 械	2022 年 1 月 7 日	124,200. 00	20,000	14	1.70	82.11	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 6955	五粮液	2022 年 1 月 7 日	2,176,60 0.00	10,000	14	1.70	1,438. 97	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 7073	万达电 影	2022 年 1 月 7 日	912,600. 00	60,000	14	1.70	603.33	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 7077	康弘药 业	2022 年 1 月 7 日	1,220,03 0.00	60,100	14	1.70	806.58	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 7081	上海机 场	2022 年 1 月 7 日	879,824. 00	17,600	14	1.70	581.66	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 7105	华润双 鹤	2022 年 1 月 7 日	1,010,56 5.00	76,500	14	1.70	668.10	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 7163	广汇汽 车	2022 年 1 月 7 日	618,750. 00	225,000	14	1.70	409.06	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 7181	浙江龙 盛	2022 年 1 月 7 日	510,048. 00	39,600	14	1.70	337.20	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 7277	东软集 团	2022 年 1 月 7 日	2,019,16 8.00	155,800	14	1.70	1,334. 89	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 070000 7325	淮北矿 业	2022 年 1 月 7 日	549,120. 00	48,000	14	1.70	363.03	-	-
兴业证券股	202201	科伦药	2022 年	2,163,29	107,200	14	1.70	1,430.	-	-

份有限公司	070000 7723	业	1月7日	6.00				18		
兴业证券股 份有限公司	202201 070000 7739	索菲亚	2022年 1月7日	2,663,36 0.00	112,000	14	1.70	1,760. 78	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 070000 8655	云海金 属	2022年 1月7日	2,802,80 0.00	130,000	14	1.70	1,852. 96	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 070000 8657	中天科 技	2022年 1月7日	1,230,40 0.00	80,000	14	1.70	813.43	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 070001 1061	亚光科 技	2022年 1月7日	2,780,79 2.00	312,800	14	3.20	3,460. 54	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 1665	双汇发 展	2022年 1月10 日	2,591,16 0.00	78,000	14	1.70	1,713. 04	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 1992	康弘药 业	2022年 1月10 日	1,031,50 0.00	50,000	14	1.70	681.94	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 2329	海尔智 家	2022年 1月10 日	392,470. 00	13,000	14	1.70	259.47	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 2497	王府井	2022年 1月10 日	390,880. 00	14,000	14	1.70	258.42	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 4721	云海金 属	2022年 1月10 日	2,619,60 0.00	120,000	14	1.70	1,731. 85	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 6515	中国中 铁	2022年 1月10 日	952,500. 00	150,000	14	1.70	629.71	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 6517	淮北矿 业	2022年 1月10 日	1,163,00 0.00	100,000	14	1.70	768.87	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 6519	浙江龙 盛	2022年 1月10 日	842,202. 00	63,900	14	1.70	556.79	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 6521	金风科 技	2022年 1月10 日	2,567,34 0.00	167,800	14	1.70	1,697. 30	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 100000 6523	盘江股 份	2022年 1月10 日	856,750. 00	115,000	14	1.70	566.41	-	-

兴业证券股份有限公司	2022011000006525	中联重科	2022 年 1 月 10 日	1,315,405.00	171,500	14	1.70	869.63	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011000006527	中国中免	2022 年 1 月 10 日	2,071,100.00	10,000	14	1.70	1,369.23	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011000006529	中牧股份	2022 年 1 月 10 日	13,690,000.00	1,000,000	14	1.70	9,050.61	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011000006531	川投能源	2022 年 1 月 10 日	1,026,600.00	87,000	14	1.70	678.70	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011000006533	云海金属	2022 年 1 月 10 日	3,165,350.00	145,000	14	1.70	2,092.65	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011000008735	万达电影	2022 年 1 月 10 日	440,154.00	28,600	14	1.70	290.99	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011000008749	中牧股份	2022 年 1 月 10 日	6,886,070.00	503,000	14	1.70	4,552.46	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200001411	三花智控	2022 年 1 月 12 日	1,130,400.00	45,000	14	1.70	747.32	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200001546	完美世界	2022 年 1 月 12 日	898,000.00	50,000	14	1.70	593.68	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200001615	贵阳银行	2022 年 1 月 12 日	677,000.00	100,000	14	1.70	447.57	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200002669	徐工机械	2022 年 1 月 12 日	1,537,500.00	250,000	14	1.70	1,016.46	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200004135	康弘药业	2022 年 1 月 12 日	2,190,240.00	105,300	14	1.70	1,447.99	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200004287	贵阳银行	2022 年 1 月 12 日	1,303,902.00	192,600	14	1.70	862.02	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200009929	万达电影	2022 年 1 月 12 日	2,099,340.00	130,800	14	1.70	1,387.90	-	-
兴业证券股份有限公司	202201120000	万达电	2022 年 1 月 12 日	738,300.00	46,000	14	1.70	488.10	-	-

	9933		日							
兴业证券股份有限公司	2022011200010027	华发股份	2022 年 1 月 12 日	770,400.00	120,000	14	1.70	509.32	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200010065	亨通光电	2022 年 1 月 12 日	1,877,751.00	125,100	14	1.70	1,241.40	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200010067	亨通光电	2022 年 1 月 12 日	1,200,800.00	80,000	14	1.70	793.86	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200010077	华海药业	2022 年 1 月 12 日	1,635,200.00	70,000	14	1.70	1,081.05	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200010089	豫园股份	2022 年 1 月 12 日	329,586.00	32,600	14	1.70	217.89	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200010093	豫园股份	2022 年 1 月 12 日	484,269.00	47,900	14	1.70	320.16	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200010111	东软集团	2022 年 1 月 12 日	2,686,125.00	188,500	14	1.70	1,775.83	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200013965	东软集团	2022 年 1 月 12 日	1,140,000.00	80,000	14	1.70	753.67	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011200013969	三七互娱	2022 年 1 月 12 日	266,300.00	10,000	14	1.70	176.05	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011300009086	安迪苏	2022 年 1 月 13 日	2,716,896.00	217,700	14	1.70	1,796.17	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011400006992	平安银行	2022 年 1 月 14 日	5,715,500.00	350,000	14	1.70	3,778.58	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011400007636	徐工机械	2022 年 1 月 14 日	1,206,000.00	200,000	14	1.70	797.30	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011400008752	巨人网络	2022 年 1 月 14 日	400,660.00	33,500	14	1.70	264.88	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011400008828	康弘药业	2022 年 1 月 14 日	2,202,120.00	108,000	14	1.70	1,455.85	-	-
兴业证券股	202201	双汇发	2022 年	2,228,88	74,000	14	1.70	1,473.	-	-

份有限公司	140000 9158	展	1 月 14 日	0.00				54		
兴业证券股 份有限公司	202201 140001 0778	金证股 份	2022 年 1 月 14 日	697,000. 00	50,000	14	1.70	460.79	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 140001 8076	中国铁 建	2022 年 1 月 14 日	792,000. 00	100,000	14	1.70	523.60	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 170000 1218	三七互 娱	2022 年 1 月 17 日	2,236,00 0.00	80,000	14	1.70	1,478. 24	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 170000 1272	辽宁成 大	2022 年 1 月 17 日	377,600. 00	20,000	14	1.70	249.64	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 180000 5434	科伦药 业	2022 年 1 月 18 日	2,216,21 6.00	111,200	14	1.70	1,465. 17	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 180000 6400	上海机 场	2022 年 1 月 18 日	1,777,32 0.00	36,000	14	1.70	1,175. 01	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 180000 6406	三七互 娱	2022 年 1 月 18 日	2,091,98 9.00	76,100	14	1.70	1,383. 04	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 180000 6450	东软集 团	2022 年 1 月 18 日	2,813,65 5.00	183,300	14	1.70	1,860. 14	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 180000 6462	陕西煤 业	2022 年 1 月 18 日	1,919,10 4.00	150,400	14	1.70	1,268. 74	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 180001 8600	贵阳银 行	2022 年 1 月 18 日	341,700. 00	51,000	14	1.70	225.90	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 190000 1097	万达电 影	2022 年 1 月 19 日	591,890. 00	37,700	14	1.70	391.31	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 190000 1195	盘江股 份	2022 年 1 月 19 日	1,508,00 0.00	200,000	14	1.70	996.96	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 190000 1362	东软集 团	2022 年 1 月 19 日	763,000. 00	50,000	7	1.60	237.38	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 190000 2445	上海医 药	2022 年 1 月 19 日	398,600. 00	20,000	14	1.70	263.52	-	-

兴业证券股份有限公司	2022011900003911	川投能源	2022 年 1 月 19 日	1,389,600.00	120,000	14	1.70	918.68	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011900006067	万达电影	2022 年 1 月 19 日	427,040.00	27,200	14	1.70	282.32	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011900007151	巨人网络	2022 年 1 月 19 日	591,000.00	50,000	14	1.70	390.72	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011900007153	三花智控	2022 年 1 月 19 日	976,000.00	40,000	14	1.70	645.24	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011900008029	东软集团	2022 年 1 月 19 日	3,514,378.00	230,300	14	1.70	2,323.39	-	-
兴业证券股份有限公司	2022011900011193	碧水源	2022 年 1 月 19 日	2,005,750.00	282,500	14	3.20	2,496.04	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012000003412	康弘药业	2022 年 1 月 20 日	4,958,808.00	256,800	14	1.70	3,278.32	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012000005900	金融街	2022 年 1 月 20 日	337,960.00	56,800	14	1.70	223.43	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012000006018	安迪苏	2022 年 1 月 20 日	573,480.00	47,200	14	1.70	379.13	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012000007590	中国神华	2022 年 1 月 20 日	663,864.00	27,800	14	1.70	438.89	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012100001155	云海金属	2022 年 1 月 21 日	2,064,000.00	100,000	14	1.70	1,364.53	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012100001428	宝钢股份	2022 年 1 月 21 日	1,062,000.00	141,600	14	1.70	702.10	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012100001450	开滦股份	2022 年 1 月 21 日	340,200.00	45,000	14	1.70	224.91	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012100002160	五粮液	2022 年 1 月 21 日	2,172,600.00	10,000	14	1.70	1,436.33	-	-
兴业证券股份有限公司	202201210000	科伦药业	2022 年 1 月 21 日	2,164,368.00	107,200	14	1.70	1,430.89	-	-

	2984		日							
兴业证券股份 有限公司	202201 210000 3024	索菲亚	2022 年 1 月 21 日	2,614,08 0.00	112,000	14	1.70	1,728. 20	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 210000 3058	康弘药 业	2022 年 1 月 21 日	1,123,87 0.00	60,100	14	1.70	743.00	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 210000 3062	万达电 影	2022 年 1 月 21 日	946,800. 00	60,000	14	1.70	625.94	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 210000 3076	上海机 场	2022 年 1 月 21 日	930,864. 00	17,600	14	1.70	615.40	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 210000 4782	徐工机 械	2022 年 1 月 21 日	120,400. 00	20,000	14	1.70	79.60	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 210000 8548	浙江龙 盛	2022 年 1 月 21 日	514,800. 00	39,600	14	1.70	340.34	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 210000 8638	东软集 团	2022 年 1 月 21 日	2,304,28 2.00	155,800	14	1.70	1,523. 39	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 210000 8706	淮北矿 业	2022 年 1 月 21 日	592,800. 00	48,000	14	1.70	391.91	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 210001 1352	亚光科 技	2022 年 1 月 21 日	2,608,75 2.00	312,800	14	3.20	3,246. 45	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 240000 1169	云海金 属	2022 年 1 月 24 日	1,267,47 5.00	60,500	14	1.70	837.94	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 240000 1708	华域汽 车	2022 年 1 月 24 日	4,473,72 0.00	154,800	14	1.70	2,957. 63	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 240000 2532	万达电 影	2022 年 1 月 24 日	449,020. 00	28,600	14	1.70	296.85	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 240000 2844	中牧股 份	2022 年 1 月 24 日	6,413,25 0.00	503,000	14	1.70	4,239. 87	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 240000 4676	中国中 铁	2022 年 1 月 24 日	969,000. 00	150,000	14	1.70	640.62	-	-
兴业证券股	202201	中国中	2022 年	2,073,00	10,000	14	1.70	1,370.	-	-

份有限公司	240000 4678	免	1 月 24 日	0.00				48		
兴业证券股 份有限公司	202201 240000 4680	川投能 源	2022 年 1 月 24 日	1,004,85 0.00	87,000	14	1.70	664.32	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 240000 4682	淮北矿 业	2022 年 1 月 24 日	1,258,00 0.00	100,000	14	1.70	831.68	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 240000 4684	盘江股 份	2022 年 1 月 24 日	865,950. 00	115,000	14	1.70	572.49	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 240000 4686	王府井	2022 年 1 月 24 日	380,800. 00	14,000	14	1.70	251.75	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 240000 4688	浙江龙 盛	2022 年 1 月 24 日	825,588. 00	63,900	14	1.70	545.81	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 240000 4690	中牧股 份	2022 年 1 月 24 日	12,750,0 00.00	1,000,00 0	14	1.70	8,429. 17	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 240000 4692	云海金 属	2022 年 1 月 24 日	3,037,75 0.00	145,000	14	1.70	2,008. 29	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 240000 6094	双汇发 展	2022 年 1 月 24 日	2,455,44 0.00	78,000	14	1.70	1,623. 32	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 260000 1296	云海金 属	2022 年 1 月 26 日	1,609,60 0.00	80,000	14	1.70	1,064. 12	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 260000 1346	巨人网 络	2022 年 1 月 26 日	508,000. 00	50,000	14	1.70	335.84	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 260000 1383	完美世 界	2022 年 1 月 26 日	683,000. 00	50,000	14	1.70	451.54	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 260000 1562	重庆百 货	2022 年 1 月 26 日	639,796. 00	23,600	14	1.70	422.98	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 260000 2306	完美世 界	2022 年 1 月 26 日	683,000. 00	50,000	14	1.70	451.54	-	-
兴业证券股 份有限公司	202201 260000 2848	康弘药 业	2022 年 1 月 26 日	1,874,34 0.00	105,300	14	1.70	1,239. 15	-	-

兴业证券股份有限公司	2022012600002850	万达电影	2022 年 1 月 26 日	1,896,600.00	130,800	14	1.70	1,253.86	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600002852	万达电影	2022 年 1 月 26 日	667,000.00	46,000	14	1.70	440.96	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600004362	华发股份	2022 年 1 月 26 日	776,400.00	120,000	14	1.70	513.29	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600004680	徐工机械	2022 年 1 月 26 日	1,425,000.00	250,000	14	1.70	942.08	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600005152	亨通光电	2022 年 1 月 26 日	1,732,635.00	125,100	14	1.70	1,145.46	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600005154	亨通光电	2022 年 1 月 26 日	1,108,000.00	80,000	14	1.70	732.51	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600005160	华海药业	2022 年 1 月 26 日	1,510,600.00	70,000	14	1.70	998.67	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600005206	豫园股份	2022 年 1 月 26 日	448,344.00	47,900	14	1.70	296.41	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600005210	豫园股份	2022 年 1 月 26 日	305,136.00	32,600	14	1.70	201.73	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600005230	东软集团	2022 年 1 月 26 日	2,699,320.00	188,500	14	1.70	1,784.55	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600005258	贵阳银行	2022 年 1 月 26 日	658,000.00	100,000	14	1.70	435.01	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012600005262	贵阳银行	2022 年 1 月 26 日	1,267,308.00	192,600	14	1.70	837.83	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012700003867	安迪苏	2022 年 1 月 27 日	2,436,063.00	217,700	14	1.70	1,610.51	-	-
兴业证券股份有限公司	2022012800000934	天坛生物	2022 年 1 月 28 日	2,524,500.00	90,000	14	1.70	1,668.98	-	-
兴业证券股份有限公司	202201280000	中牧股份	2022 年 1 月 28 日	483,600.00	40,000	14	1.70	319.71	-	-

	0961		日							
兴业证券股份 有限公司	202201 280000 6208	巨人网 络	2022 年 1 月 28 日	327,295. 00	33,500	14	1.70	216.38	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 280000 6272	康弘药 业	2022 年 1 月 28 日	1,786,32 0.00	108,000	14	1.70	1,180. 96	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 280001 0402	中国铁 建	2022 年 1 月 28 日	806,000. 00	100,000	14	1.70	532.86	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 280001 3652	平安银 行	2022 年 1 月 28 日	5,540,50 0.00	350,000	14	1.70	3,662. 89	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 280001 3698	徐工机 械	2022 年 1 月 28 日	1,128,00 0.00	200,000	14	1.70	745.73	-	-
兴业证券股份 有限公司	202201 280001 3792	双汇发 展	2022 年 1 月 28 日	2,205,20 0.00	74,000	14	1.70	1,457. 88	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070000 0963	亚光科 技	2022 年 2 月 7 日	4,104,22 5.00	566,100	14	3.20	5,107. 48	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070000 2088	云海金 属	2022 年 2 月 7 日	423,574. 00	21,800	14	1.70	280.03	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070000 2339	陕西煤 业	2022 年 2 月 7 日	414,990. 00	31,800	14	1.70	274.35	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070000 2461	天坛生 物	2022 年 2 月 7 日	2,515,29 3.00	89,100	14	1.70	1,662. 89	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070000 2675	锦江酒 店	2022 年 2 月 7 日	703,104. 00	12,800	14	1.70	464.83	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070000 5483	中国中 铁	2022 年 2 月 7 日	991,500. 00	150,000	14	1.70	655.49	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070000 5547	中国中 免	2022 年 2 月 7 日	2,108,10 0.00	10,000	14	1.70	1,393. 69	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070000 6891	万达电 影	2022 年 2 月 7 日	382,668. 00	28,600	14	1.70	252.99	-	-
兴业证券股	202202	万达电	2022 年	504,426.	37,700	14	1.70	333.48	-	-

份有限公司	070000 6895	影	2月7日	00						
兴业证券股 份有限公司	202202 070000 8677	中牧股 份	2022年 2月7日	6,282,47 0.00	503,000	14	1.70	4,153. 41	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070000 8689	三七互 娱	2022年 2月7日	1,980,00 0.00	80,000	14	1.70	1,309. 00	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070001 0295	徐工机 械	2022年 2月7日	115,600. 00	20,000	14	1.70	76.42	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070001 1305	五粮液	2022年 2月7日	1,956,20 0.00	10,000	14	1.70	1,293. 27	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 5869	巨人网 络	2022年 2月7日	493,500. 00	50,000	14	1.70	326.26	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 6695	开滦股 份	2022年 2月7日	310,050. 00	45,000	14	1.70	204.98	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 6699	云海金 属	2022年 2月7日	1,175,51 5.00	60,500	14	1.70	777.15	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 6701	云海金 属	2022年 2月7日	1,943,00 0.00	100,000	14	1.70	1,284. 54	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 9041	中国神 华	2022年 2月7日	653,578. 00	27,800	14	1.70	432.09	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 9043	安迪苏	2022年 2月7日	540,440. 00	47,200	14	1.70	357.29	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 9045	康弘药 业	2022年 2月7日	4,339,92 0.00	256,800	14	1.70	2,869. 17	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 9047	东软集 团	2022年 2月7日	3,168,92 8.00	230,300	14	1.70	2,095. 01	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 9049	金 融 街	2022年 2月7日	327,168. 00	56,800	14	1.70	216.29	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 070002 9051	川投能 源	2022年 2月7日	1,368,00 0.00	120,000	14	1.70	904.40	-	-

兴业证券股份有限公司	2022020700029053	盘江股份	2022 年 2 月 7 日	1,378,000.00	200,000	14	1.70	911.01	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700029055	上海医药	2022 年 2 月 7 日	384,600.00	20,000	14	1.70	254.26	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700029057	东软集团	2022 年 2 月 7 日	2,522,208.00	183,300	14	1.70	1,667.46	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700029059	陕西煤业	2022 年 2 月 7 日	1,962,720.00	150,400	14	1.70	1,297.58	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700029061	上海机场	2022 年 2 月 7 日	1,879,200.00	36,000	14	1.70	1,242.36	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700029063	三七互娱	2022 年 2 月 7 日	1,883,475.00	76,100	14	1.70	1,245.19	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700029065	科伦药业	2022 年 2 月 7 日	1,968,240.00	111,200	14	1.70	1,301.23	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700029069	辽宁成大	2022 年 2 月 7 日	342,800.00	20,000	14	1.70	226.63	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700029071	贵阳银行	2022 年 2 月 7 日	338,130.00	51,000	14	1.70	223.54	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700030797	浙江龙盛	2022 年 2 月 7 日	803,223.00	63,900	14	1.70	531.02	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700030803	浙江龙盛	2022 年 2 月 7 日	497,772.00	39,600	14	1.70	329.08	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700030837	盘江股份	2022 年 2 月 7 日	792,350.00	115,000	14	1.70	523.83	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700031015	川投能源	2022 年 2 月 7 日	991,800.00	87,000	14	1.70	655.69	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020700034275	云海金属	2022 年 2 月 7 日	2,817,350.00	145,000	14	1.70	1,862.58	-	-
兴业证券股份有限公司	202202070003	科伦药业	2022 年 2 月 7 日	1,897,440.00	107,200	14	1.70	1,254.42	-	-

	4377									
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 4457	索菲亚	2022 年 2 月 7 日	2,453,92 0.00	112,000	14	1.70	1,622. 31	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 4509	万达电 影	2022 年 2 月 7 日	802,800. 00	60,000	14	1.70	530.74	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 4527	康弘药 业	2022 年 2 月 7 日	1,015,69 0.00	60,100	14	1.70	671.48	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 4561	上海机 场	2022 年 2 月 7 日	918,720. 00	17,600	14	1.70	607.38	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 9565	东软集 团	2022 年 2 月 7 日	2,143,80 8.00	155,800	14	1.70	1,417. 30	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 9573	华域汽 车	2022 年 2 月 7 日	4,411,80 0.00	154,800	14	1.70	2,916. 69	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 9657	王府井	2022 年 2 月 7 日	388,780. 00	14,000	14	1.70	257.03	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 9745	淮北矿 业	2022 年 2 月 7 日	1,176,00 0.00	100,000	14	1.70	777.47	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 9753	淮北矿 业	2022 年 2 月 7 日	564,480. 00	48,000	14	1.70	373.18	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070003 9919	中牧股 份	2022 年 2 月 7 日	12,490,0 00.00	1,000,00 0	14	1.70	8,257. 28	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070004 7251	碧水源	2022 年 2 月 7 日	1,892,75 0.00	282,500	14	3.20	2,355. 42	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 070005 4589	亚光科 技	2022 年 2 月 7 日	2,267,80 0.00	312,800	14	3.20	2,822. 15	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 090000 1904	招商蛇 口	2022 年 2 月 9 日	650,862. 00	45,900	14	1.70	430.29	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 090000 2142	中南传 媒	2022 年 2 月 9 日	371,124. 00	36,600	14	1.70	245.35	-	-
兴业证券股	202202	金证股	2022 年	495,600.	30,000	14	1.70	327.65	-	-

份有限公司	090000 2244	份	2月9日	00						
兴业证券股 份有限公司	202202 090000 2263	盘江股 份	2022年 2月9日	216,600. 00	30,000	14	1.70	143.20	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090000 2544	中国神 华	2022年 2月9日	1,222,00 0.00	50,000	14	1.70	807.88	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090000 2545	建发股 份	2022年 2月9日	2,429,50 4.00	255,200	14	1.70	1,606. 17	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090000 2562	中国神 华	2022年 2月9日	889,616. 00	36,400	14	1.70	588.14	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090000 2637	中国铁 建	2022年 2月9日	258,300. 00	30,000	14	1.70	170.77	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090001 1798	云海金 属	2022年 2月9日	1,640,00 0.00	80,000	14	1.70	1,084. 22	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090001 1804	巨人网 络	2022年 2月9日	510,000. 00	50,000	14	1.70	337.17	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090001 1810	完美世 界	2022年 2月9日	706,000. 00	50,000	14	1.70	466.74	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090001 1812	完美世 界	2022年 2月9日	706,000. 00	50,000	14	1.70	466.74	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090001 1814	康弘药 业	2022年 2月9日	1,820,63 7.00	105,300	14	1.70	1,203. 64	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090001 1822	万达电 影	2022年 2月9日	627,440. 00	46,000	14	1.70	414.81	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090001 1824	万达电 影	2022年 2月9日	1,784,11 2.00	130,800	14	1.70	1,179. 50	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090001 1832	华发股 份	2022年 2月9日	794,400. 00	120,000	14	1.70	525.19	-	-
兴业证券股 份有限公司	202202 090001 1836	亨通光 电	2022年 2月9日	1,155,20 0.00	80,000	14	1.70	763.72	-	-

兴业证券股份有限公司	2022020900011838	亨通光电	2022 年 2 月 9 日	1,806,444.00	125,100	14	1.70	1,194.26	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020900011844	豫园股份	2022 年 2 月 9 日	329,260.00	32,600	14	1.70	217.68	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020900011846	豫园股份	2022 年 2 月 9 日	483,790.00	47,900	14	1.70	319.84	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020900011848	重庆百货	2022 年 2 月 9 日	660,092.00	23,600	14	1.70	436.39	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020900011850	东软集团	2022 年 2 月 9 日	2,753,985.00	188,500	14	1.70	1,820.69	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020900011864	贵阳银行	2022 年 2 月 9 日	1,303,902.00	192,600	14	1.70	862.02	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020900011866	贵阳银行	2022 年 2 月 9 日	677,000.00	100,000	14	1.70	447.57	-	-
兴业证券股份有限公司	2022020900013106	徐工机械	2022 年 2 月 9 日	1,470,000.00	250,000	14	1.70	971.83	-	-
兴业证券股份有限公司	2022021000010604	安迪苏	2022 年 2 月 10 日	2,660,294.00	217,700	14	1.70	1,758.75	-	-
兴业证券股份有限公司	2022021100001060	亚光科技	2022 年 2 月 11 日	320,352.00	42,600	14	3.20	398.66	-	-
兴业证券股份有限公司	2022021100001316	华润三九	2022 年 2 月 11 日	1,068,600.00	30,000	14	1.70	706.46	-	-
兴业证券股份有限公司	2022021100001331	美年健康	2022 年 2 月 11 日	675,980.00	92,600	14	1.70	446.90	-	-
兴业证券股份有限公司	2022021100001529	金证股份	2022 年 2 月 11 日	217,750.00	13,000	14	1.70	143.96	-	-
兴业证券股份有限公司	2022021100001536	东软集团	2022 年 2 月 11 日	133,900.00	10,000	14	1.70	88.52	-	-
兴业证券股份有限公司	202202110001	天坛生物	2022 年 2 月 11 日	2,503,800.00	90,000	14	1.70	1,655.29	-	-

	4996		日							
兴业证券股份 有限公司	202202 110001 4998	康弘药 业	2022 年 2 月 11 日	1,811,16 0.00	108,000	14	1.70	1,197. 38	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 110001 5000	平安银 行	2022 年 2 月 11 日	5,985,00 0.00	350,000	14	1.70	3,956. 75	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 110001 5002	中国铁 建	2022 年 2 月 11 日	859,000. 00	100,000	14	1.70	567.89	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 110001 5004	巨人网 络	2022 年 2 月 11 日	329,975. 00	33,500	14	1.70	218.15	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 110001 5006	徐工机 械	2022 年 2 月 11 日	1,168,00 0.00	200,000	14	1.70	772.18	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 110001 5008	双汇发 展	2022 年 2 月 11 日	2,276,98 0.00	74,000	14	1.70	1,505. 34	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 140000 1085	云海金 属	2022 年 2 月 14 日	2,159,10 0.00	90,000	14	1.70	1,427. 41	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 140000 1382	华海药 业	2022 年 2 月 14 日	993,000. 00	50,000	14	1.70	656.48	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 160000 0477	亚光科 技	2022 年 2 月 16 日	370,392. 00	48,800	14	3.40	489.74	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 180000 1524	建发股 份	2022 年 2 月 18 日	425,574. 00	42,600	14	1.70	281.35	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210000 5839	中牧股 份	2022 年 2 月 21 日	6,715,05 0.00	503,000	14	1.70	4,439. 39	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210000 5861	三七互 娱	2022 年 2 月 21 日	1,911,20 0.00	80,000	14	1.70	1,263. 52	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210000 5879	开滦股 份	2022 年 2 月 21 日	353,700. 00	45,000	14	1.70	233.84	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210000 6943	万达电 影	2022 年 2 月 21 日	402,974. 00	28,600	14	1.70	266.41	-	-
兴业证券股	202202	万达电	2022 年	531,193.	37,700	14	1.70	351.18	-	-

份有限公司	2100006949	影	2 月 21 日	00						
兴业证券股份 有限公司	2022022100010657	科伦药 业	2022 年 2 月 21 日	1,907,088.00	107,200	14	1.70	1,260.80	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100010665	科伦药 业	2022 年 2 月 21 日	1,978,248.00	111,200	14	1.70	1,307.84	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100013927	金 融 街	2022 年 2 月 21 日	337,960.00	56,800	14	1.70	223.43	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100013937	徐工机 械	2022 年 2 月 21 日	114,600.00	20,000	14	1.70	75.76	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100014265	五粮液	2022 年 2 月 21 日	1,992,000.00	10,000	14	1.70	1,316.93	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100017483	天坛生 物	2022 年 2 月 21 日	2,493,909.00	89,100	14	1.70	1,648.75	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100017545	中牧股 份	2022 年 2 月 21 日	13,350,000.00	1,000,000	14	1.70	8,825.83	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100017681	安迪苏	2022 年 2 月 21 日	578,200.00	47,200	14	1.70	382.25	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100017749	浙江龙 盛	2022 年 2 月 21 日	814,725.00	63,900	14	1.70	538.62	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100017825	盘江股 份	2022 年 2 月 21 日	1,622,000.00	200,000	14	1.70	1,072.32	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100017895	盘江股 份	2022 年 2 月 21 日	932,650.00	115,000	14	1.70	616.59	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100018649	贵阳银 行	2022 年 2 月 21 日	345,270.00	51,000	14	1.70	228.26	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100018947	川投能 源	2022 年 2 月 21 日	1,441,200.00	120,000	14	1.70	952.79	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022100018969	川投能 源	2022 年 2 月 21 日	1,044,870.00	87,000	14	1.70	690.78	-	-

兴业证券股份 有限公司	202202 210001 9019	东软集 团	2022 年 2 月 21 日	3,180,44 3.00	230,300	14	1.70	2,102. 63	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210001 9027	东软集 团	2022 年 2 月 21 日	2,151,59 8.00	155,800	14	1.70	1,422. 45	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210001 9031	东软集 团	2022 年 2 月 21 日	2,531,37 3.00	183,300	14	1.70	1,673. 52	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210001 9053	辽宁成 大	2022 年 2 月 21 日	338,000. 00	20,000	14	1.70	223.46	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210001 9057	华域汽 车	2022 年 2 月 21 日	4,063,50 0.00	154,800	14	1.70	2,686. 43	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210001 9207	王府井	2022 年 2 月 21 日	393,400. 00	14,000	14	1.70	260.08	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210001 9359	淮北矿 业	2022 年 2 月 21 日	1,362,00 0.00	100,000	14	1.70	900.43	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210001 9363	淮北矿 业	2022 年 2 月 21 日	653,760. 00	48,000	14	1.70	432.21	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210001 9397	中国神 华	2022 年 2 月 21 日	734,198. 00	27,800	14	1.70	485.39	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 3761	云海金 属	2022 年 2 月 21 日	3,577,15 0.00	145,000	14	1.70	2,364. 89	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 3791	三七互 娱	2022 年 2 月 21 日	1,818,02 9.00	76,100	14	1.70	1,201. 92	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 3813	索菲亚	2022 年 2 月 21 日	2,744,00 0.00	112,000	14	1.70	1,814. 09	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 3963	万达电 影	2022 年 2 月 21 日	845,400. 00	60,000	14	1.70	558.90	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 3965	康弘药 业	2022 年 2 月 21 日	1,025,30 6.00	60,100	14	1.70	677.84	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002	康弘药 业	2022 年 2 月 21	4,381,00 8.00	256,800	14	1.70	2,896. 33	-	-

	3967		日							
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 4071	上海机 场	2022 年 2 月 21 日	2,040,48 0.00	36,000	14	1.70	1,348. 98	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 4077	上海机 场	2022 年 2 月 21 日	997,568. 00	17,600	14	1.70	659.50	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 5579	陕西煤 业	2022 年 2 月 21 日	2,218,40 0.00	150,400	14	1.70	1,466. 61	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 5617	中国中 铁	2022 年 2 月 21 日	985,500. 00	150,000	14	1.70	651.53	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 5673	上海医 药	2022 年 2 月 21 日	384,200. 00	20,000	14	1.70	254.00	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210002 5837	中国中 免	2022 年 2 月 21 日	2,155,50 0.00	10,000	14	1.70	1,425. 03	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210003 0265	云海金 属	2022 年 2 月 21 日	1,492,53 5.00	60,500	14	1.70	986.73	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210003 0267	云海金 属	2022 年 2 月 21 日	2,467,00 0.00	100,000	14	1.70	1,630. 96	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210003 0271	云海金 属	2022 年 2 月 21 日	537,806. 00	21,800	14	1.70	355.55	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210003 9013	亚光科 技	2022 年 2 月 21 日	2,402,30 4.00	312,800	14	3.20	2,989. 53	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210003 9015	碧水源	2022 年 2 月 21 日	1,974,67 5.00	282,500	14	3.20	2,457. 37	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 210003 9017	亚光科 技	2022 年 2 月 21 日	4,347,64 8.00	566,100	14	3.20	5,410. 41	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 230000 0267	亚光科 技	2022 年 2 月 23 日	23,190.0 0	3,000	14	3.40	30.66	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 230000 6974	建发股 份	2022 年 2 月 23 日	2,580,07 2.00	255,200	14	1.70	1,705. 71	-	-
兴业证券股	202202	华发股	2022 年	771,600.	120,000	14	1.70	510.11	-	-

份有限公司	2300006998	份	2 月 23 日	00						
兴业证券股份 有限公司	2022022300007010	金证股份	2022 年 2 月 23 日	505,200.00	30,000	14	1.70	333.99	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007020	亨通光电	2022 年 2 月 23 日	1,895,265.00	125,100	14	1.70	1,252.98	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007144	贵阳银行	2022 年 2 月 23 日	668,000.00	100,000	14	1.70	441.62	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007146	贵阳银行	2022 年 2 月 23 日	1,286,568.00	192,600	14	1.70	850.56	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007222	东软集团	2022 年 2 月 23 日	2,693,665.00	188,500	14	1.70	1,780.81	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007224	重庆百货	2022 年 2 月 23 日	618,320.00	23,600	14	1.70	408.78	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007262	中国神华	2022 年 2 月 23 日	1,275,500.00	50,000	14	1.70	843.25	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007270	中南传媒	2022 年 2 月 23 日	356,850.00	36,600	14	1.70	235.92	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007778	招商蛇口	2022 年 2 月 23 日	635,715.00	45,900	14	1.70	420.28	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007812	云海金属	2022 年 2 月 23 日	2,064,000.00	80,000	14	1.70	1,364.53	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007820	巨人网络	2022 年 2 月 23 日	501,500.00	50,000	14	1.70	331.55	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007826	完美世界	2022 年 2 月 23 日	686,500.00	50,000	14	1.70	453.85	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007830	完美世界	2022 年 2 月 23 日	686,500.00	50,000	14	1.70	453.85	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022022300007850	万达电影	2022 年 2 月 23 日	1,806,348.00	130,800	14	1.70	1,194.20	-	-

兴业证券股份有限公司	2022022300007854	万达电影	2022 年 2 月 23 日	635,260.00	46,000	14	1.70	419.98	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022300007858	康弘药业	2022 年 2 月 23 日	1,803,789.00	105,300	14	1.70	1,192.50	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022300009464	盘江股份	2022 年 2 月 23 日	242,700.00	30,000	14	1.70	160.45	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022300009468	中国铁建	2022 年 2 月 23 日	249,600.00	30,000	14	1.70	165.01	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500000391	亚光科技	2022 年 2 月 25 日	138,960.00	18,000	14	3.40	183.74	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500001137	招商蛇口	2022 年 2 月 25 日	369,644.00	27,100	14	1.70	244.38	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500001253	巨人网络	2022 年 2 月 25 日	536,250.00	55,000	14	1.70	354.52	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500010213	东软集团	2022 年 2 月 25 日	134,500.00	10,000	14	1.70	88.92	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500010383	中国铁建	2022 年 2 月 25 日	798,000.00	100,000	14	1.70	527.57	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500011413	金证股份	2022 年 2 月 25 日	200,850.00	13,000	14	1.70	132.78	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500013925	徐工机械	2022 年 2 月 25 日	1,114,000.00	200,000	14	1.70	736.48	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500014067	双汇发展	2022 年 2 月 25 日	2,108,260.00	74,000	14	1.70	1,393.79	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500014129	华润三九	2022 年 2 月 25 日	1,084,500.00	30,000	14	1.70	716.98	-	-
兴业证券股份有限公司	2022022500014231	巨人网络	2022 年 2 月 25 日	326,625.00	33,500	14	1.70	215.94	-	-
兴业证券股份有限公司	202202250001	康弘药业	2022 年 2 月 25 日	1,830,600.00	108,000	14	1.70	1,210.23	-	-

	4301		日							
兴业证券股份 有限公司	202202 250001 9635	亚光科 技	2022 年 2 月 25 日	328,872. 00	42,600	14	3.20	409.26	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 280000 0973	招商蛇 口	2022 年 2 月 28 日	317,070. 00	23,400	14	1.70	209.62	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 280000 1018	云海金 属	2022 年 2 月 28 日	1,243,00 0.00	50,000	14	1.70	821.76	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 280000 2105	云海金 属	2022 年 2 月 28 日	2,237,40 0.00	90,000	14	1.70	1,479. 17	-	-
兴业证券股份 有限公司	202202 280000 2823	华海药 业	2022 年 2 月 28 日	1,158,00 0.00	50,000	14	1.70	765.57	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 020000 3481	亚光科 技	2022 年 3 月 2 日	374,784. 00	48,800	14	3.40	495.55	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 040000 1132	华侨城 A	2022 年 3 月 4 日	2,052,52 8.00	292,800	14	1.70	1,356. 95	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 040000 1315	万达电 影	2022 年 3 月 4 日	366,647. 00	26,900	14	1.70	242.39	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 040000 1434	东软集 团	2022 年 3 月 4 日	511,810. 00	40,300	14	1.70	338.36	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 040000 1617	广汇汽 车	2022 年 3 月 4 日	384,000. 00	150,000	14	1.70	253.87	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 070000 0724	亚光科 技	2022 年 3 月 7 日	414,960. 00	57,000	14	3.40	548.67	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 070000 0730	碧水源	2022 年 3 月 7 日	641,000. 00	100,000	14	3.20	797.69	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 070000 1839	贵阳银 行	2022 年 3 月 7 日	715,000. 00	110,000	14	1.70	472.69	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 070000 2848	贵阳银 行	2022 年 3 月 7 日	331,500. 00	51,000	14	1.70	219.16	-	-
兴业证券股	202203	上海医	2022 年	386,000.	20,000	14	1.70	255.19	-	-

份有限公司	070000 2850	药	3月7日	00						
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2852	陕西煤 业	2022年 3月7日	2,283,07 2.00	150,400	14	1.70	1,509. 36	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2854	中国中 铁	2022年 3月7日	939,000. 00	150,000	14	1.70	620.78	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2856	淮北矿 业	2022年 3月7日	688,320. 00	48,000	14	1.70	455.06	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2858	中国神 华	2022年 3月7日	751,990. 00	27,800	14	1.70	497.15	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2860	淮北矿 业	2022年 3月7日	1,434,00 0.00	100,000	14	1.70	948.03	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2862	王府井	2022年 3月7日	339,640. 00	14,000	14	1.70	224.54	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2864	盘江股 份	2022年 3月7日	1,710,00 0.00	200,000	14	1.70	1,130. 50	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2866	盘江股 份	2022年 3月7日	983,250. 00	115,000	14	1.70	650.04	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2868	辽宁成 大	2022年 3月7日	337,200. 00	20,000	14	1.70	222.93	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2870	浙江龙 盛	2022年 3月7日	761,688. 00	63,900	14	1.70	503.56	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2872	东软集 团	2022年 3月7日	2,271,08 7.00	183,300	14	1.70	1,501. 44	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2874	安迪苏	2022年 3月7日	609,352. 00	47,200	14	1.70	402.85	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2876	上海机 场	2022年 3月7日	1,836,72 0.00	36,000	14	1.70	1,214. 28	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 070000 2878	川投能 源	2022年 3月7日	1,443,60 0.00	120,000	14	1.70	954.38	-	-

兴业证券股份有限公司	202203 070000 2880	三七互 娱	2022 年 3 月 7 日	1,535,69 8.00	76,100	14	1.70	1,015. 27	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070000 2882	中牧股 份	2022 年 3 月 7 日	13,300,0 00.00	1,000,00 0	14	1.70	8,792. 78	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070000 2884	康弘药 业	2022 年 3 月 7 日	1,016,89 2.00	60,100	14	1.70	672.28	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070000 2886	科伦药 业	2022 年 3 月 7 日	1,963,79 2.00	111,200	14	1.70	1,298. 28	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070000 2888	万达电 影	2022 年 3 月 7 日	799,200. 00	60,000	14	1.70	528.36	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070000 2890	科伦药 业	2022 年 3 月 7 日	1,893,15 2.00	107,200	14	1.70	1,251. 58	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070000 2892	云海金 属	2022 年 3 月 7 日	3,272,65 0.00	145,000	14	1.70	2,163. 59	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070000 2894	五粮液	2022 年 3 月 7 日	1,660,00 0.00	10,000	14	1.70	1,097. 44	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070000 2896	徐工机 械	2022 年 3 月 7 日	110,000. 00	20,000	14	1.70	72.72	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070000 2898	金融 街	2022 年 3 月 7 日	324,328. 00	56,800	14	1.70	214.42	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070002 7224	三七互 娱	2022 年 3 月 7 日	1,614,40 0.00	80,000	14	1.70	1,067. 30	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070002 7240	云海金 属	2022 年 3 月 7 日	2,257,00 0.00	100,000	14	1.70	1,492. 13	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070003 0020	万达电 影	2022 年 3 月 7 日	502,164. 00	37,700	14	1.70	331.99	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070004 3400	亚光科 技	2022 年 3 月 7 日	4,121,20 8.00	566,100	14	3.20	5,128. 61	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 070004	亚光科 技	2022 年 3 月 7 日	2,277,18 4.00	312,800	14	3.20	2,833. 83	-	-

	3402									
兴业证券股份 有限公司	202203 070004 3404	碧水源	2022 年 3 月 7 日	1,810,82 5.00	282,500	14	3.20	2,253. 47	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 2833	巨人网 络	2022 年 3 月 9 日	440,500. 00	50,000	14	1.70	291.22	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 2843	完美世 界	2022 年 3 月 9 日	595,000. 00	50,000	14	1.70	393.36	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 2857	万达电 影	2022 年 3 月 9 日	1,652,00 4.00	130,800	14	1.70	1,092. 16	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 2861	万达电 影	2022 年 3 月 9 日	580,980. 00	46,000	14	1.70	384.09	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 2871	康弘药 业	2022 年 3 月 9 日	1,650,05 1.00	105,300	14	1.70	1,090. 87	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 3749	华发股 份	2022 年 3 月 9 日	733,200. 00	120,000	14	1.70	484.73	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 3761	金证股 份	2022 年 3 月 9 日	435,000. 00	30,000	14	1.70	287.58	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 3765	亨通光 电	2022 年 3 月 9 日	1,612,53 9.00	125,100	14	1.70	1,066. 07	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 3783	重庆百 货	2022 年 3 月 9 日	570,648. 00	23,600	14	1.70	377.26	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 6215	中国神 华	2022 年 3 月 9 日	1,346,00 0.00	50,000	14	1.70	889.86	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 6217	中南传 媒	2022 年 3 月 9 日	338,550. 00	36,600	14	1.70	223.82	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 6683	招商蛇 口	2022 年 3 月 9 日	647,190. 00	45,900	14	1.70	427.86	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 090000 6705	云海金 属	2022 年 3 月 9 日	1,684,80 0.00	80,000	14	1.70	1,113. 84	-	-
兴业证券股	202203	贵阳银	2022 年	1,186,41	192,600	14	1.70	784.35	-	-

份有限公司	090001 3783	行	3月9日	6.00						
兴业证券股 份有限公司	202203 090001 3785	贵阳银 行	2022年 3月9日	616,000. 00	100,000	14	1.70	407.24	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 090001 4053	盘江股 份	2022年 3月9日	249,000. 00	30,000	14	1.70	164.62	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110000 1032	中联重 科	2022年 3月11 日	2,552,00 4.00	373,100	14	1.70	1,687. 16	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110000 1040	TCL科 技	2022年 3月11 日	2,180,43 7.00	426,700	14	1.70	1,441. 51	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110000 1170	云海金 属	2022年 3月11 日	2,203,20 0.00	102,000	14	1.70	1,456. 56	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110000 1229	三七互 娱	2022年 3月11 日	1,018,50 0.00	50,000	14	1.70	673.34	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110000 4092	中国铁 建	2022年 3月11 日	776,000. 00	100,000	14	1.70	513.02	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110000 7116	徐工机 械	2022年 3月11 日	1,050,00 0.00	200,000	14	1.70	694.17	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110000 9424	双汇发 展	2022年 3月11 日	2,094,20 0.00	74,000	14	1.70	1,384. 50	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110000 9564	巨人网 络	2022年 3月11 日	326,290. 00	33,500	14	1.70	215.71	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110000 9566	巨人网 络	2022年 3月11 日	535,700. 00	55,000	14	1.70	354.16	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110001 1076	康弘药 业	2022年 3月11 日	1,749,60 0.00	108,000	14	1.70	1,156. 68	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110001 4690	金证股 份	2022年 3月11 日	189,020. 00	13,000	14	1.70	124.96	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 110001 7308	亚光科 技	2022年 3月11 日	299,478. 00	42,600	14	3.20	372.68	-	-

兴业证券股份有限公司	202203 140000 1297	中联重 科	2022 年 3 月 14 日	1,358,00 0.00	200,000	14	1.70	897.79	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 140000 1463	美年健 康	2022 年 3 月 14 日	1,052,45 4.00	170,300	14	1.70	695.79	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 140000 1466	美年健 康	2022 年 3 月 14 日	1,236,00 0.00	200,000	14	1.70	817.13	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 140000 1656	康弘药 业	2022 年 3 月 14 日	233,600. 00	14,600	14	1.70	154.44	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 140000 1836	中南传 媒	2022 年 3 月 14 日	490,000. 00	50,000	14	1.70	323.94	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 140000 2072	开滦股 份	2022 年 3 月 14 日	229,200. 00	30,000	14	1.70	151.53	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 140000 4300	华海药 业	2022 年 3 月 14 日	1,345,00 0.00	50,000	14	1.70	889.19	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 140000 4924	云海金 属	2022 年 3 月 14 日	1,928,70 0.00	90,000	14	1.70	1,275. 09	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 140000 4926	云海金 属	2022 年 3 月 14 日	1,071,50 0.00	50,000	14	1.70	708.38	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 180000 3894	广汇汽 车	2022 年 3 月 18 日	348,000. 00	150,000	14	1.70	230.07	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 210000 2647	金融 街	2022 年 3 月 21 日	308,424. 00	56,800	14	1.70	203.90	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 210000 2663	徐工机 械	2022 年 3 月 21 日	102,600. 00	20,000	14	1.70	67.83	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 210000 3489	云海金 属	2022 年 3 月 21 日	3,056,60 0.00	145,000	14	1.70	2,020. 75	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 210000 7119	中国中 铁	2022 年 3 月 21 日	868,500. 00	150,000	14	1.70	574.18	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 210001	淮北矿 业	2022 年 3 月 21	1,414,00 0.00	100,000	14	1.70	934.81	-	-

	6643		日							
兴业证券股份 有限公司	202203 210001 6645	淮北矿 业	2022 年 3 月 21 日	678,720. 00	48,000	14	1.70	448.71	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210001 6761	陕西煤 业	2022 年 3 月 21 日	2,231,93 6.00	150,400	14	1.70	1,475. 56	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210001 7753	三七互 娱	2022 年 3 月 21 日	1,805,60 0.00	80,000	14	1.70	1,193. 70	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210001 7775	云海金 属	2022 年 3 月 21 日	2,108,00 0.00	100,000	14	1.70	1,393. 62	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210001 9441	科伦药 业	2022 年 3 月 21 日	1,847,05 6.00	107,200	14	1.70	1,221. 11	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210001 9521	三七互 娱	2022 年 3 月 21 日	1,717,57 7.00	76,100	14	1.70	1,135. 51	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210001 9919	万达电 影	2022 年 3 月 21 日	747,600. 00	60,000	14	1.70	494.25	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210001 9929	康弘药 业	2022 年 3 月 21 日	957,393. 00	60,100	14	1.70	632.94	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210001 9981	上海机 场	2022 年 3 月 21 日	1,893,60 0.00	36,000	14	1.70	1,251. 88	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210002 0141	王府井	2022 年 3 月 21 日	300,580. 00	14,000	14	1.70	198.72	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210002 0169	贵阳银 行	2022 年 3 月 21 日	667,700. 00	110,000	14	1.70	441.42	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210002 0175	贵阳银 行	2022 年 3 月 21 日	309,570. 00	51,000	14	1.70	204.66	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210002 1025	五粮液	2022 年 3 月 21 日	1,657,10 0.00	10,000	14	1.70	1,095. 53	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 210002 1191	安迪苏	2022 年 3 月 21 日	468,696. 00	47,200	14	1.70	309.86	-	-
兴业证券股	202203	浙江龙	2022 年	691,398.	63,900	14	1.70	457.09	-	-

份有限公司	210002 1513	盛	3 月 21 日	00						
兴业证券股 份有限公司	202203 210002 1579	盘江股 份	2022 年 3 月 21 日	937,250. 00	115,000	14	1.70	619.63	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 210002 1583	盘江股 份	2022 年 3 月 21 日	1,630,00 0.00	200,000	14	1.70	1,077. 61	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 210002 2761	川投能 源	2022 年 3 月 21 日	1,315,20 0.00	120,000	14	1.70	869.49	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 210002 5629	中牧股 份	2022 年 3 月 21 日	12,360,0 00.00	1,000,00 0	14	1.70	8,171. 33	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 210003 3197	亚光科 技	2022 年 3 月 21 日	2,224,00 8.00	312,800	14	3.20	2,767. 65	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 210003 3199	碧水源	2022 年 3 月 21 日	595,000. 00	100,000	14	3.20	740.44	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 210003 3201	碧水源	2022 年 3 月 21 日	1,680,87 5.00	282,500	14	3.20	2,091. 76	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 210003 3747	亚光科 技	2022 年 3 月 21 日	405,270. 00	57,000	14	3.40	535.86	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 230000 3137	云海金 属	2022 年 3 月 23 日	1,710,40 0.00	80,000	14	1.70	1,130. 76	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 230000 7089	巨人网 络	2022 年 3 月 23 日	500,000. 00	50,000	14	1.70	330.56	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 230000 7099	完美世 界	2022 年 3 月 23 日	675,500. 00	50,000	14	1.70	446.58	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 230000 7129	万达电 影	2022 年 3 月 23 日	574,540. 00	46,000	14	1.70	379.83	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 230000 7131	万达电 影	2022 年 3 月 23 日	1,633,69 2.00	130,800	14	1.70	1,080. 05	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 230000 7137	康弘药 业	2022 年 3 月 23 日	1,657,42 2.00	105,300	14	1.70	1,095. 74	-	-

兴业证券股份有限公司	202203 230000 7167	重庆百货	2022 年 3 月 23 日	601,564. 00	23,600	14	1.70	397.70	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 230000 7211	中南传媒	2022 年 3 月 23 日	352,092. 00	36,600	14	1.70	232.77	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 230000 8497	盘江股份	2022 年 3 月 23 日	247,200. 00	30,000	14	1.70	163.43	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 230000 9813	贵阳银行	2022 年 3 月 23 日	614,000. 00	100,000	14	1.70	405.92	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 230000 9815	贵阳银行	2022 年 3 月 23 日	1,182,56 4.00	192,600	14	1.70	781.81	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 230001 0279	招商蛇口	2022 年 3 月 23 日	667,845. 00	45,900	14	1.70	441.52	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 230001 0317	金证股份	2022 年 3 月 23 日	403,500. 00	30,000	14	1.70	266.76	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 230001 0325	亨通光电	2022 年 3 月 23 日	1,746,39 6.00	125,100	14	1.70	1,154. 56	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 250000 1007	华润三九	2022 年 3 月 25 日	1,136,70 0.00	30,000	14	1.70	751.49	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 250000 1206	华润双鹤	2022 年 3 月 25 日	751,000. 00	50,000	14	1.70	496.49	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 250000 1241	上海医药	2022 年 3 月 25 日	379,500. 00	15,000	14	1.70	250.89	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 250000 1299	重庆百货	2022 年 3 月 25 日	268,600. 00	10,000	14	1.70	177.57	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 250000 8476	徐工机械	2022 年 3 月 25 日	1,016,00 0.00	200,000	14	1.70	671.69	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 250001 0962	双汇发展	2022 年 3 月 25 日	1,961,74 0.00	74,000	14	1.70	1,296. 93	-	-
兴业证券股份有限公司	202203 250001	中国铁建	2022 年 3 月 25	743,000. 00	100,000	14	1.70	491.21	-	-

	1288		日							
兴业证券股份 有限公司	202203 250001 1612	金证股 份	2022 年 3 月 25 日	169,000. 00	13,000	14	1.70	111.73	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 250001 1614	云海金 属	2022 年 3 月 25 日	2,161,38 0.00	102,000	14	1.70	1,428. 91	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 250001 2502	三七互 娱	2022 年 3 月 25 日	1,105,50 0.00	50,000	14	1.70	730.86	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 250001 2506	巨人网 络	2022 年 3 月 25 日	534,600. 00	55,000	14	1.70	353.43	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 250001 2510	巨人网 络	2022 年 3 月 25 日	325,620. 00	33,500	14	1.70	215.27	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 250001 2560	康弘药 业	2022 年 3 月 25 日	1,696,68 0.00	108,000	14	1.70	1,121. 69	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 250001 8410	亚光科 技	2022 年 3 月 25 日	294,366. 00	42,600	14	3.20	366.32	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 280000 0783	双汇发 展	2022 年 3 月 28 日	293,700. 00	11,000	14	1.70	194.17	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 280000 0801	招商蛇 口	2022 年 3 月 28 日	268,278. 00	18,300	14	1.70	177.36	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 280000 1117	锦江酒 店	2022 年 3 月 28 日	481,400. 00	10,000	14	1.70	318.26	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 280000 2683	华海药 业	2022 年 3 月 28 日	1,076,00 0.00	50,000	14	1.70	711.36	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 280000 2703	中南传 媒	2022 年 3 月 28 日	472,500. 00	50,000	14	1.70	312.38	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 280000 2781	中联重 科	2022 年 3 月 28 日	1,314,00 0.00	200,000	14	1.70	868.70	-	-
兴业证券股份 有限公司	202203 280000 2819	美年健 康	2022 年 3 月 28 日	980,928. 00	170,300	14	1.70	648.50	-	-
兴业证券股	202203	云海金	2022 年	1,021,00	50,000	14	1.70	674.99	-	-

份有限公司	280000 3439	属	3 月 28 日	0.00						
兴业证券股 份有限公司	202203 280000 3441	云海金 属	2022 年 3 月 28 日	1,837,80 0.00	90,000	14	1.70	1,214. 99	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 280000 3449	康弘药 业	2022 年 3 月 28 日	226,446. 00	14,600	14	1.70	149.71	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 300000 1764	药明康 德	2022 年 3 月 30 日	1,134,50 0.00	10,000	14	1.70	750.03	-	-
兴业证券股 份有限公司	202203 300000 1888	开滦股 份	2022 年 3 月 30 日	237,000. 00	30,000	14	1.70	156.68	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 010000 1380	科伦药 业	2022 年 4 月 1 日	1,382,40 0.00	80,000	14	1.70	913.92	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 010000 1406	索菲亚	2022 年 4 月 1 日	202,800. 00	10,400	14	1.70	134.07	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 010000 1414	康弘药 业	2022 年 4 月 1 日	2,015,77 5.00	127,500	14	1.70	1,332. 65	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 010000 1416	万达电 影	2022 年 4 月 1 日	531,720. 00	42,000	14	1.70	351.53	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 010000 1682	长电科 技	2022 年 4 月 1 日	908,950. 00	37,100	14	1.70	600.92	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 010000 1713	浙江龙 盛	2022 年 4 月 1 日	3,766,30 8.00	344,900	14	1.70	2,489. 95	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 010000 1745	建发股 份	2022 年 4 月 1 日	1,330,00 0.00	100,000	14	1.70	879.28	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 010000 2688	广汇汽 车	2022 年 4 月 1 日	357,000. 00	150,000	14	1.70	236.02	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 060000 1251	华侨城 A	2022 年 4 月 6 日	2,633,40 0.00	332,500	14	1.70	1,740. 97	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 060000 1266	徐工机 械	2022 年 4 月 6 日	214,236. 00	39,600	14	1.70	141.63	-	-

兴业证券股份有限公司	202204 060000 1351	招商蛇 口	2022 年 4 月 6 日	2,839,23 2.00	174,400	14	1.70	1,877. 05	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060000 1386	金风科 技	2022 年 4 月 6 日	1,306,00 0.00	100,000	14	1.70	863.41	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060000 1453	完美世 界	2022 年 4 月 6 日	495,924. 00	37,400	14	1.70	327.86	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060000 1735	金地集 团	2022 年 4 月 6 日	608,000. 00	40,000	14	1.70	401.96	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060000 3635	贵阳银 行	2022 年 4 月 6 日	659,000. 00	100,000	14	1.70	435.67	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002 0113	招商蛇 口	2022 年 4 月 6 日	747,252. 00	45,900	14	1.70	494.02	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002 2183	云海金 属	2022 年 4 月 6 日	1,543,20 0.00	80,000	14	1.70	1,020. 23	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002 2907	三七互 娱	2022 年 4 月 6 日	1,948,80 0.00	80,000	14	1.70	1,288. 37	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002 3031	云海金 属	2022 年 4 月 6 日	1,929,00 0.00	100,000	14	1.70	1,275. 28	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002 3749	淮北矿 业	2022 年 4 月 6 日	1,586,00 0.00	100,000	14	1.70	1,048. 52	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002 3751	淮北矿 业	2022 年 4 月 6 日	761,280. 00	48,000	14	1.70	503.29	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002 3753	贵阳银 行	2022 年 4 月 6 日	724,900. 00	110,000	14	1.70	479.24	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002 3755	贵阳银 行	2022 年 4 月 6 日	336,090. 00	51,000	14	1.70	222.19	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002 3757	盘江股 份	2022 年 4 月 6 日	991,300. 00	115,000	14	1.70	655.36	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 060002	王府井	2022 年 4 月 6 日	299,320. 00	14,000	14	1.70	197.88	-	-

	3759									
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 3761	浙江龙 盛	2022 年 4 月 6 日	713,124. 00	63,900	14	1.70	471.45	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 3763	川投能 源	2022 年 4 月 6 日	1,354,80 0.00	120,000	14	1.70	895.67	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 3765	康弘药 业	2022 年 4 月 6 日	960,398. 00	60,100	14	1.70	634.93	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 3767	万达电 影	2022 年 4 月 6 日	767,400. 00	60,000	14	1.70	507.34	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 3769	中牧股 份	2022 年 4 月 6 日	12,760,0 00.00	1,000,00 0	14	1.70	8,435. 78	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 3771	三七互 娱	2022 年 4 月 6 日	1,853,79 6.00	76,100	14	1.70	1,225. 57	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 3773	盘江股 份	2022 年 4 月 6 日	1,724,00 0.00	200,000	14	1.70	1,139. 76	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 3775	上海机 场	2022 年 4 月 6 日	1,841,40 0.00	36,000	14	1.70	1,217. 37	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 3777	云海金 属	2022 年 4 月 6 日	2,797,05 0.00	145,000	14	1.70	1,849. 16	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060002 8953	贵阳银 行	2022 年 4 月 6 日	1,269,23 4.00	192,600	14	1.70	839.10	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060003 0833	亨通光 电	2022 年 4 月 6 日	1,581,26 4.00	125,100	14	1.70	1,045. 39	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060003 1009	重庆百 货	2022 年 4 月 6 日	640,032. 00	23,600	14	1.70	423.13	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060003 3385	中南传 媒	2022 年 4 月 6 日	367,830. 00	36,600	14	1.70	243.18	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 060004 3227	万达电 影	2022 年 4 月 6 日	1,672,93 2.00	130,800	14	1.70	1,105. 99	-	-
兴业证券股	202204	康弘药	2022 年	1,682,69	105,300	14	1.70	1,112.	-	-

份有限公司	060004 3231	业	4月6日	4.00				45		
兴业证券股 份有限公司	202204 060006 0857	亚光科 技	2022年 4月6日	2,092,63 2.00	312,800	14	3.20	2,604. 16	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 060006 0859	碧水源	2022年 4月6日	1,717,60 0.00	282,500	14	3.20	2,137. 46	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 060006 0861	碧水源	2022年 4月6日	608,000. 00	100,000	14	3.20	756.62	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080000 1175	华侨城 A	2022年 4月8日	2,026,31 5.00	263,500	14	1.70	1,339. 62	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080000 1347	科伦药 业	2022年 4月8日	1,172,50 0.00	70,000	14	1.70	775.15	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080000 1508	金证股 份	2022年 4月8日	195,000. 00	15,000	14	1.70	128.92	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080000 1613	华发股 份	2022年 4月8日	655,200. 00	80,000	14	1.70	433.16	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080000 4263	华润三 九	2022年 4月8日	1,194,00 0.00	30,000	14	1.70	789.37	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080001 1413	金证股 份	2022年 4月8日	169,000. 00	13,000	14	1.70	111.73	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080001 1415	云海金 属	2022年 4月8日	1,976,76 0.00	102,000	14	1.70	1,306. 86	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080001 1417	上海医 药	2022年 4月8日	313,650. 00	15,000	14	1.70	207.36	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080001 2971	中国铁 建	2022年 4月8日	846,000. 00	100,000	14	1.70	559.30	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080001 3339	徐工机 械	2022年 4月8日	1,112,00 0.00	200,000	14	1.70	735.16	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 080001 3425	三七互 娱	2022年 4月8日	1,162,50 0.00	50,000	14	1.70	768.54	-	-

兴业证券股份有限公司	2022040800013431	巨人网络	2022 年 4 月 8 日	332,655.00	33,500	14	1.70	219.92	-	-
兴业证券股份有限公司	2022040800013433	巨人网络	2022 年 4 月 8 日	546,150.00	55,000	14	1.70	361.07	-	-
兴业证券股份有限公司	2022040800013461	康弘药业	2022 年 4 月 8 日	1,657,800.00	108,000	14	1.70	1,095.99	-	-
兴业证券股份有限公司	2022040800013473	华润双鹤	2022 年 4 月 8 日	736,000.00	50,000	14	1.70	486.58	-	-
兴业证券股份有限公司	2022040800016851	亚光科技	2022 年 4 月 8 日	271,362.00	42,600	14	3.20	337.69	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041100001142	金融街	2022 年 4 月 11 日	266,800.00	40,000	14	1.70	176.38	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041100001147	中联重科	2022 年 4 月 11 日	1,488,744.00	213,900	14	1.70	984.23	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041100001466	索菲亚	2022 年 4 月 11 日	1,326,000.00	65,000	14	1.70	876.63	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041100003361	康弘药业	2022 年 4 月 11 日	217,394.00	14,600	14	1.70	143.72	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041100004327	锦江酒店	2022 年 4 月 11 日	491,000.00	10,000	14	1.70	324.61	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041100005425	中南传媒	2022 年 4 月 11 日	480,000.00	50,000	14	1.70	317.33	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041100005427	华海药业	2022 年 4 月 11 日	539,400.00	30,000	14	1.70	356.60	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041100005429	美年健康	2022 年 4 月 11 日	955,383.00	170,300	14	1.70	631.61	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041100005645	云海金属	2022 年 4 月 11 日	909,000.00	50,000	14	1.70	600.95	-	-
兴业证券股份有限公司	202204110000	云海金属	2022 年 4 月 11 日	1,636,200.00	90,000	14	1.70	1,081.71	-	-

	5649		日							
兴业证券股份有限公司	2022041300001918	巨人网络	2022 年 4 月 13 日	573,600.00	60,000	14	1.70	379.21	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041300002676	建发股份	2022 年 4 月 13 日	2,140,550.00	155,000	14	1.70	1,415.14	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041300007822	开滦股份	2022 年 4 月 13 日	254,100.00	30,000	14	1.70	167.99	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041500001293	中牧股份	2022 年 4 月 15 日	374,625.00	33,300	14	1.70	247.67	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041500002038	建发股份	2022 年 4 月 15 日	1,414,000.00	100,000	14	1.70	934.81	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041500002042	索菲亚	2022 年 4 月 15 日	223,392.00	10,400	14	1.70	147.69	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041500002254	科伦药业	2022 年 4 月 15 日	1,292,000.00	80,000	14	1.70	854.16	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041500002660	康弘药业	2022 年 4 月 15 日	1,866,600.00	127,500	14	1.70	1,234.03	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041500002710	广汇汽车	2022 年 4 月 15 日	355,500.00	150,000	14	1.70	235.03	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041500002720	浙江龙盛	2022 年 4 月 15 日	3,724,920.00	344,900	14	1.70	2,462.59	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041800001155	招商蛇口	2022 年 4 月 18 日	1,628,000.00	100,000	14	1.70	1,076.29	-	-
兴业证券股份有限公司	2022041800001291	完美世界	2022 年 4 月 18 日	821,077.00	66,700	14	1.70	542.82	-	-
兴业证券股份有限公司	2022042000001461	徐工机械	2022 年 4 月 20 日	524,000.00	100,000	14	1.70	346.42	-	-
兴业证券股份有限公司	2022042000001598	云海金属	2022 年 4 月 20 日	1,960,172.00	106,300	14	1.70	1,295.89	-	-
兴业证券股	202204	万达电	2022 年	1,533,60	120,000	14	1.70	1,013.	-	-

份有限公司	2000001753	影	4 月 20 日	0.00				88		
兴业证券股份 有限公司	2022042000001847	盘江股份	2022 年 4 月 20 日	370,240.00	44,500	14	1.70	244.77	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000002032	中牧股份	2022 年 4 月 20 日	1,990,152.00	157,200	14	1.70	1,315.71	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000002063	中牧股份	2022 年 4 月 20 日	291,180.00	23,000	14	1.70	192.50	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000003568	云海金属	2022 年 4 月 20 日	1,844,000.00	100,000	14	1.70	1,219.09	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000010304	招商蛇口	2022 年 4 月 20 日	704,106.00	45,900	14	1.70	465.49	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000014452	华侨城 A	2022 年 4 月 20 日	2,300,900.00	332,500	14	1.70	1,521.15	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000014688	云海金属	2022 年 4 月 20 日	1,475,200.00	80,000	14	1.70	975.27	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000014718	万达电影	2022 年 4 月 20 日	766,800.00	60,000	14	1.70	506.94	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000014734	康弘药业	2022 年 4 月 20 日	1,518,426.00	105,300	14	1.70	1,003.85	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000014742	康弘药业	2022 年 4 月 20 日	866,642.00	60,100	14	1.70	572.95	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000014820	浙江龙盛	2022 年 4 月 20 日	673,506.00	63,900	14	1.70	445.26	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000014864	王府井	2022 年 4 月 20 日	321,300.00	14,000	14	1.70	212.42	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000014922	贵阳银行	2022 年 4 月 20 日	320,280.00	51,000	14	1.70	211.74	-	-
兴业证券股份 有限公司	2022042000014926	贵阳银行	2022 年 4 月 20 日	628,000.00	100,000	14	1.70	415.18	-	-

兴业证券股份有限公司	202204 200001 4930	贵阳银行	2022 年 4 月 20 日	690,800. 00	110,000	14	1.70	456.70	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200001 7062	完美世界	2022 年 4 月 20 日	492,932. 00	37,400	14	1.70	325.88	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200001 7082	徐工机械	2022 年 4 月 20 日	207,504. 00	39,600	14	1.70	137.18	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200001 7122	三七互娱	2022 年 4 月 20 日	1,748,80 0.00	80,000	14	1.70	1,156. 15	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200002 1514	上海机场	2022 年 4 月 20 日	1,836,00 0.00	36,000	14	1.70	1,213. 80	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200002 1982	金风科技	2022 年 4 月 20 日	1,175,00 0.00	100,000	14	1.70	776.81	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200002 2368	三七互娱	2022 年 4 月 20 日	1,663,54 6.00	76,100	14	1.70	1,099. 79	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200002 2632	淮北矿业	2022 年 4 月 20 日	1,506,00 0.00	100,000	14	1.70	995.63	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200002 2682	中南传媒	2022 年 4 月 20 日	345,138. 00	36,600	14	1.70	228.17	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200003 1882	盘江股份	2022 年 4 月 20 日	1,664,00 0.00	200,000	14	1.70	1,100. 09	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200003 1952	亨通光电	2022 年 4 月 20 日	1,398,61 8.00	125,100	14	1.70	924.64	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200003 2216	川投能源	2022 年 4 月 20 日	1,312,80 0.00	120,000	14	1.70	867.91	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200003 2282	重庆百货	2022 年 4 月 20 日	632,244. 00	23,600	14	1.70	417.98	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200004 9406	亚光科技	2022 年 4 月 20 日	1,904,95 2.00	312,800	14	3.20	2,370. 61	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 200004	碧水源	2022 年 4 月 20	513,000. 00	100,000	14	3.20	638.40	-	-

	9408		日							
兴业证券股份 有限公司	202204 200004 9410	碧水源	2022 年 4 月 20 日	1,449,22 5.00	282,500	14	3.20	1,803. 48	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220000 1161	上海莱 士	2022 年 4 月 22 日	216,800. 00	40,000	14	1.70	143.33	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220000 1325	盘江股 份	2022 年 4 月 22 日	401,000. 00	50,000	14	1.70	265.11	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220000 1481	华发股 份	2022 年 4 月 22 日	290,072. 00	40,400	14	1.70	191.77	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220000 5586	华发股 份	2022 年 4 月 22 日	574,400. 00	80,000	14	1.70	379.74	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220000 8356	中国铁 建	2022 年 4 月 22 日	777,000. 00	100,000	14	1.70	513.68	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220000 8590	徐工机 械	2022 年 4 月 22 日	1,032,00 0.00	200,000	14	1.70	682.27	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220000 9302	华润三 九	2022 年 4 月 22 日	1,026,00 0.00	30,000	14	1.70	678.30	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220001 1520	康弘药 业	2022 年 4 月 22 日	1,494,72 0.00	108,000	14	1.70	988.18	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220001 2050	金证股 份	2022 年 4 月 22 日	134,940. 00	13,000	14	1.70	89.21	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220001 2052	金证股 份	2022 年 4 月 22 日	155,700. 00	15,000	14	1.70	102.94	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220001 2054	云海金 属	2022 年 4 月 22 日	1,859,46 0.00	102,000	14	1.70	1,229. 31	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220001 2332	科伦药 业	2022 年 4 月 22 日	1,122,10 0.00	70,000	14	1.70	741.83	-	-
兴业证券股份 有限公司	202204 220001 2364	三七互 娱	2022 年 4 月 22 日	1,057,00 0.00	50,000	14	1.70	698.79	-	-
兴业证券股	202204	巨人网	2022 年	484,000.	55,000	14	1.70	319.98	-	-

份有限公司	220001 2366	络	4 月 22 日	00						
兴业证券股 份有限公司	202204 220001 2368	巨人网 络	2022 年 4 月 22 日	294,800. 00	33,500	14	1.70	194.90	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 250000 2171	锦江酒 店	2022 年 4 月 25 日	493,100. 00	10,000	14	1.70	325.99	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 250000 2201	金 融 街	2022 年 4 月 25 日	223,200. 00	40,000	14	1.70	147.56	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 250000 2739	美年健 康	2022 年 4 月 25 日	848,094. 00	170,300	14	1.70	560.68	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 250000 2831	索菲亚	2022 年 4 月 25 日	1,192,10 0.00	65,000	14	1.70	788.11	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 250000 3679	中联重 科	2022 年 4 月 25 日	1,255,59 3.00	213,900	14	1.70	830.09	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 250000 3907	华海药 业	2022 年 4 月 25 日	429,300. 00	30,000	14	1.70	283.82	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 250000 3959	中南传 媒	2022 年 4 月 25 日	452,500. 00	50,000	14	1.70	299.15	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 250000 4061	云海金 属	2022 年 4 月 25 日	820,500. 00	50,000	14	1.70	542.44	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 270000 0281	亚光科 技	2022 年 4 月 27 日	549,792. 00	110,400	14	3.40	726.95	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 270000 1295	索菲亚	2022 年 4 月 27 日	283,427. 00	15,100	14	1.70	187.38	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 270000 1690	华润双 鹤	2022 年 4 月 27 日	1,216,80 0.00	45,000	14	1.70	804.44	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 270000 4207	开滦股 份	2022 年 4 月 27 日	211,800. 00	30,000	14	1.70	140.02	-	-
兴业证券股 份有限公司	202204 270000 7937	巨人网 络	2022 年 4 月 27 日	488,400. 00	60,000	14	1.70	322.89	-	-

兴业证券股份有限公司	202204 270000 8437	建发股份	2022 年 4 月 27 日	2,024,30 0.00	155,000	14	1.70	1,338. 29	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 0372	亚光科技	2022 年 4 月 29 日	2,139,15 6.00	409,800	14	3.20	2,662. 06	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 0374	碧水源	2022 年 4 月 29 日	515,900. 00	110,000	14	3.40	682.13	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 1122	TCL 科技	2022 年 4 月 29 日	515,394. 00	123,300	14	1.70	340.73	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 1393	三七互娱	2022 年 4 月 29 日	724,500. 00	30,000	14	1.70	478.98	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 1417	完美世界	2022 年 4 月 29 日	590,800. 00	40,000	14	1.70	390.58	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 1689	中牧股份	2022 年 4 月 29 日	265,920. 00	24,000	14	1.70	175.80	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 3186	索菲亚	2022 年 4 月 29 日	212,160. 00	10,400	14	1.70	140.26	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 3188	中牧股份	2022 年 4 月 29 日	368,964. 00	33,300	14	1.70	243.93	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 3438	建发股份	2022 年 4 月 29 日	1,446,00 0.00	100,000	14	1.70	955.97	-	-
兴业证券股份有限公司	202204 290000 4110	科伦药业	2022 年 4 月 29 日	1,356,00 0.00	80,000	14	1.70	896.47	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 050000 5009	贵阳银行	2022 年 5 月 5 日	674,300. 00	110,000	14	1.70	445.79	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 050000 5013	贵阳银行	2022 年 5 月 5 日	613,000. 00	100,000	14	1.70	405.26	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 050000 9129	三七互娱	2022 年 5 月 5 日	1,901,60 0.00	80,000	14	1.70	1,257. 17	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 050000	完美世界	2022 年 5 月 5 日	988,494. 00	66,700	14	1.70	653.50	-	-

	9193									
兴业证券股份 有限公司	202205 050000 9197	完美世 界	2022 年 5 月 5 日	554,268. 00	37,400	14	1.70	366.43	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050000 9201	徐工机 械	2022 年 5 月 5 日	198,792. 00	39,600	14	1.70	131.42	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050000 9207	徐工机 械	2022 年 5 月 5 日	502,000. 00	100,000	14	1.70	331.88	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050000 9229	中牧股 份	2022 年 5 月 5 日	262,660. 00	23,000	14	1.70	173.65	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050000 9235	云海金 属	2022 年 5 月 5 日	1,748,00 0.00	100,000	14	1.70	1,155. 62	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050001 2603	云海金 属	2022 年 5 月 5 日	1,858,12 4.00	106,300	14	1.70	1,228. 43	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050001 2607	云海金 属	2022 年 5 月 5 日	1,398,40 0.00	80,000	14	1.70	924.50	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050001 4941	三七互 娱	2022 年 5 月 5 日	1,808,89 7.00	76,100	14	1.70	1,195. 88	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050002 8723	万达电 影	2022 年 5 月 5 日	679,200. 00	60,000	14	1.70	449.03	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050002 8733	万达电 影	2022 年 5 月 5 日	1,358,40 0.00	120,000	14	1.70	898.05	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050003 5711	王府井	2022 年 5 月 5 日	318,360. 00	14,000	14	1.70	210.47	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050003 5809	淮北矿 业	2022 年 5 月 5 日	1,400,00 0.00	100,000	14	1.70	925.56	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050004 5807	中牧股 份	2022 年 5 月 5 日	1,795,22 4.00	157,200	14	1.70	1,186. 84	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 050004 7419	盘江股 份	2022 年 5 月 5 日	1,686,00 0.00	200,000	14	1.70	1,114. 63	-	-
兴业证券股	202205	盘江股	2022 年	375,135.	44,500	14	1.70	248.01	-	-

份有限公司	050004 7421	份	5月5日	00						
兴业证券股 份有限公司	202205 050004 8547	川投能 源	2022年 5月5日	1,354,80 0.00	120,000	14	1.70	895.67	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 050007 3727	碧水源	2022年 5月5日	1,307,97 5.00	282,500	14	3.20	1,627. 70	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 050007 3729	碧水源	2022年 5月5日	463,000. 00	100,000	14	3.20	576.18	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060000 1331	招商蛇 口	2022年 5月6日	1,278,78 4.00	92,800	14	1.70	845.42	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060000 1336	招商蛇 口	2022年 5月6日	2,812,49 8.00	204,100	14	1.70	1,859. 37	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060000 1524	完美世 界	2022年 5月6日	277,200. 00	20,000	14	1.70	183.26	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060000 1602	辽宁成 大	2022年 5月6日	258,600. 00	20,000	14	1.70	170.96	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060000 1926	重庆百 货	2022年 5月6日	1,002,75 0.00	35,000	14	1.70	662.93	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060000 1950	建发股 份	2022年 5月6日	1,004,00 0.00	80,000	14	1.70	663.76	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060001 0971	金证股 份	2022年 5月6日	136,800. 00	15,000	14	1.70	90.44	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060001 0973	盘江股 份	2022年 5月6日	404,500. 00	50,000	14	1.70	267.42	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060001 0975	云海金 属	2022年 5月6日	1,714,62 0.00	102,000	14	1.70	1,133. 55	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060001 2251	上海莱 士	2022年 5月6日	230,000. 00	40,000	14	1.70	152.06	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 060001 2755	徐工机 械	2022年 5月6日	978,000. 00	200,000	14	1.70	646.57	-	-

兴业证券股份 有限公司	202205 060001 2885	华润三 九	2022 年 5 月 6 日	1,162,80 0.00	30,000	14	1.70	768.74	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 060001 2973	科伦药 业	2022 年 5 月 6 日	1,185,10 0.00	70,000	14	1.70	783.48	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 060001 2997	三七互 娱	2022 年 5 月 6 日	1,138,00 0.00	50,000	14	1.70	752.34	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 060001 2999	巨人网 络	2022 年 5 月 6 日	276,040. 00	33,500	14	1.70	182.49	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 060001 3001	巨人网 络	2022 年 5 月 6 日	453,200. 00	55,000	14	1.70	299.62	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 060001 3061	康弘药 业	2022 年 5 月 6 日	1,501,20 0.00	108,000	14	1.70	992.46	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 060001 3181	华发股 份	2022 年 5 月 6 日	584,800. 00	80,000	14	1.70	386.62	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 060001 3339	中国铁 建	2022 年 5 月 6 日	823,000. 00	100,000	14	1.70	544.09	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 1848	华侨城 A	2022 年 5 月 9 日	2,364,30 6.00	411,900	14	1.70	1,563. 07	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 2039	华润三 九	2022 年 5 月 9 日	394,600. 00	10,000	14	1.70	260.87	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 2299	万达电 影	2022 年 5 月 9 日	1,205,60 0.00	110,000	14	1.70	797.04	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 2463	川投能 源	2022 年 5 月 9 日	889,110. 00	80,100	14	1.70	587.80	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 2466	金证股 份	2022 年 5 月 9 日	220,320. 00	24,000	14	1.70	145.66	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 2535	盘江股 份	2022 年 5 月 9 日	234,300. 00	30,000	14	1.70	154.90	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000	华发股 份	2022 年 5 月 9 日	289,600. 00	40,000	14	1.70	191.46	-	-

	2823									
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 2824	华友钴 业	2022 年 5 月 9 日	2,315,10 0.00	30,000	14	1.70	1,530. 54	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 2855	华海药 业	2022 年 5 月 9 日	259,500. 00	15,000	14	1.70	171.56	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 2866	锦江酒 店	2022 年 5 月 9 日	483,000. 00	10,000	14	1.70	319.32	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 3025	金地集 团	2022 年 5 月 9 日	575,080. 00	44,000	14	1.70	380.19	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 7137	华海药 业	2022 年 5 月 9 日	519,000. 00	30,000	14	1.70	343.12	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 7139	索菲亚	2022 年 5 月 9 日	1,227,20 0.00	65,000	14	1.70	811.32	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 7141	美年健 康	2022 年 5 月 9 日	844,688. 00	170,300	14	1.70	558.43	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 7143	中联重 科	2022 年 5 月 9 日	1,229,92 5.00	213,900	14	1.70	813.12	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 090000 7975	金融 街	2022 年 5 月 9 日	247,600. 00	40,000	14	1.70	163.69	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 110000 0155	禾川科 技	2022 年 5 月 11 日	48,288.0 0	2,400	14	3.40	63.85	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 110000 0441	亚光科 技	2022 年 5 月 11 日	544,000. 00	100,000	14	3.20	676.98	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 110000 0896	双汇发 展	2022 年 5 月 11 日	312,936. 00	10,200	14	1.70	206.89	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 110000 1167	上海建 工	2022 年 5 月 11 日	318,000. 00	100,000	14	1.70	210.23	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 110000 1210	贵阳银 行	2022 年 5 月 11 日	1,085,40 0.00	180,000	14	1.70	717.57	-	-
兴业证券股	202205	锦江酒	2022 年	519,000.	10,000	14	1.70	343.12	-	-

份有限公司	110000 1401	店	5 月 11 日	00						
兴业证券股 份有限公司	202205 110000 1540	广汇汽 车	2022 年 5 月 11 日	221,000. 00	100,000	14	1.70	146.11	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 110000 2622	华润双 鹤	2022 年 5 月 11 日	1,575,00 0.00	45,000	14	1.70	1,041. 25	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 110000 3296	开滦股 份	2022 年 5 月 11 日	207,900. 00	30,000	14	1.70	137.45	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 110000 5730	索菲亚	2022 年 5 月 11 日	285,088. 00	15,100	14	1.70	188.47	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 110001 1206	亚光科 技	2022 年 5 月 11 日	600,576. 00	110,400	14	3.40	794.09	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 130000 1159	万达电 影	2022 年 5 月 13 日	115,200. 00	10,000	14	1.70	76.16	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 130000 1190	上海建 工	2022 年 5 月 13 日	127,600. 00	40,000	14	1.70	84.36	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 130000 1197	贵阳银 行	2022 年 5 月 13 日	607,607. 00	100,100	14	1.70	401.70	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 130000 1400	上海医 药	2022 年 5 月 13 日	421,200. 00	20,000	14	1.70	278.46	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 130000 1419	建发股 份	2022 年 5 月 13 日	914,193. 00	69,100	14	1.70	604.38	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 130000 1421	开滦股 份	2022 年 5 月 13 日	68,800.0 0	10,000	14	1.70	45.48	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 130000 1446	广汇汽 车	2022 年 5 月 13 日	76,230.0 0	33,000	14	1.70	50.40	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 130000 2254	完美世 界	2022 年 5 月 13 日	563,200. 00	40,000	14	1.70	372.34	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 130000 2298	科伦药 业	2022 年 5 月 13 日	1,465,60 0.00	80,000	14	1.70	968.92	-	-

兴业证券股份有限公司	2022051300002306	三七互娱	2022 年 5 月 13 日	671,700.00	30,000	14	1.70	444.07	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051300002716	TCL 科技	2022 年 5 月 13 日	524,025.00	123,300	14	1.70	346.44	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051300002774	中牧股份	2022 年 5 月 13 日	388,278.00	33,300	14	1.70	256.69	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051300002776	中牧股份	2022 年 5 月 13 日	279,840.00	24,000	14	1.70	185.01	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051300002778	索菲亚	2022 年 5 月 13 日	201,760.00	10,400	14	1.70	133.39	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051300004118	建发股份	2022 年 5 月 13 日	1,323,000.00	100,000	14	1.70	874.65	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051300005248	碧水源	2022 年 5 月 13 日	529,100.00	110,000	14	3.40	699.59	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051300006016	亚光科技	2022 年 5 月 13 日	2,241,606.00	409,800	14	3.20	2,789.55	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051600001090	淮北矿业	2022 年 5 月 16 日	142,200.00	10,000	14	1.70	94.01	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051600001312	中国神华	2022 年 5 月 16 日	2,011,900.00	64,900	14	1.70	1,330.09	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051800001174	双汇发展	2022 年 5 月 18 日	2,067,360.00	70,800	14	1.70	1,366.75	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051800001447	淮北矿业	2022 年 5 月 18 日	352,000.00	25,000	14	1.70	232.71	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051800001454	贵阳银行	2022 年 5 月 18 日	150,500.00	25,000	14	1.70	99.50	-	-
兴业证券股份有限公司	2022051900003491	中牧股份	2022 年 5 月 19 日	1,894,260.00	157,200	14	1.70	1,252.32	-	-
兴业证券股份有限公司	202205190000	王府井	2022 年 5 月 19 日	309,680.00	14,000	14	1.70	204.73	-	-

	4887		日							
兴业证券股份 有限公司	202205 190000 7239	万达电 影	2022 年 5 月 19 日	1,374,00 0.00	120,000	14	1.70	908.37	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190000 7245	万达电 影	2022 年 5 月 19 日	687,000. 00	60,000	14	1.70	454.18	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190000 9563	川投能 源	2022 年 5 月 19 日	1,389,60 0.00	120,000	14	1.70	918.68	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190001 5097	云海金 属	2022 年 5 月 19 日	1,441,60 0.00	80,000	14	1.70	953.06	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190001 5103	云海金 属	2022 年 5 月 19 日	1,915,52 6.00	106,300	14	1.70	1,266. 38	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190001 8071	完美世 界	2022 年 5 月 19 日	538,560. 00	37,400	14	1.70	356.05	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190001 8083	完美世 界	2022 年 5 月 19 日	960,480. 00	66,700	14	1.70	634.98	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190001 8087	中牧股 份	2022 年 5 月 19 日	277,150. 00	23,000	14	1.70	183.23	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190001 8093	三七互 娱	2022 年 5 月 19 日	1,724,00 0.00	80,000	14	1.70	1,139. 76	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190002 3363	云海金 属	2022 年 5 月 19 日	1,802,00 0.00	100,000	14	1.70	1,191. 32	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190002 5225	贵阳银 行	2022 年 5 月 19 日	601,000. 00	100,000	14	1.70	397.33	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190002 5227	贵阳银 行	2022 年 5 月 19 日	661,100. 00	110,000	14	1.70	437.06	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190003 0567	盘江股 份	2022 年 5 月 19 日	1,752,00 0.00	200,000	14	1.70	1,158. 27	-	-
兴业证券股份 有限公司	202205 190003 0575	盘江股 份	2022 年 5 月 19 日	389,820. 00	44,500	14	1.70	257.71	-	-
兴业证券股	202205	碧水源	2022 年	480,000.	100,000	14	3.20	597.33	-	-

份有限公司	190004 3653		5 月 19 日	00						
兴业证券股 份有限公司	202205 200000 0389	华大基 因	2022 年 5 月 20 日	265,080. 00	4,000	14	3.40	350.49	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200000 1016	碧水源	2022 年 5 月 20 日	580,800. 00	120,000	14	3.20	722.77	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200000 1029	中联重 科	2022 年 5 月 20 日	1,174,00 0.00	200,000	14	1.70	776.14	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200000 1245	三七互 娱	2022 年 5 月 20 日	1,732,00 0.00	80,000	14	1.70	1,145. 04	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200000 1351	淮北矿 业	2022 年 5 月 20 日	727,500. 00	50,000	14	1.70	480.96	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200000 2868	徐工机 械	2022 年 5 月 20 日	1,038,00 0.00	200,000	14	1.70	686.23	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200000 3190	科伦药 业	2022 年 5 月 20 日	1,231,30 0.00	70,000	14	1.70	814.03	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200000 6012	三七互 娱	2022 年 5 月 20 日	1,082,50 0.00	50,000	14	1.70	715.65	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200000 8670	康弘药 业	2022 年 5 月 20 日	1,535,76 0.00	108,000	14	1.70	1,015. 31	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200001 0360	华发股 份	2022 年 5 月 20 日	578,400. 00	80,000	14	1.70	382.39	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200001 0544	云海金 属	2022 年 5 月 20 日	1,912,50 0.00	102,000	14	1.70	1,264. 38	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200001 0866	中国铁 建	2022 年 5 月 20 日	837,000. 00	100,000	14	1.70	553.35	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200001 0980	建发股 份	2022 年 5 月 20 日	1,143,20 0.00	80,000	14	1.70	755.78	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 200001 1290	重庆百 货	2022 年 5 月 20 日	755,650. 00	35,000	14	1.70	499.57	-	-

兴业证券股份有限公司	2022052000011294	辽宁成大	2022 年 5 月 20 日	273,800.00	20,000	14	1.70	181.01	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052000011356	巨人网络	2022 年 5 月 20 日	466,400.00	55,000	14	1.70	308.34	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052000011522	华润三九	2022 年 5 月 20 日	1,211,700.00	30,000	14	1.70	801.07	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052000011526	招商蛇口	2022 年 5 月 20 日	2,718,612.00	204,100	14	1.70	1,797.30	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052000012774	上海莱士	2022 年 5 月 20 日	225,200.00	40,000	14	1.70	148.88	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052300000333	碧水源	2022 年 5 月 23 日	586,800.00	120,000	14	3.40	775.88	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052300000994	云海金属	2022 年 5 月 23 日	2,089,186.00	106,700	14	1.70	1,381.18	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052300001198	金证股份	2022 年 5 月 23 日	155,840.00	16,000	14	1.70	103.03	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052300001215	盘江股份	2022 年 5 月 23 日	458,000.00	50,000	14	1.70	302.79	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052300002767	金融街	2022 年 5 月 23 日	244,800.00	40,000	14	1.70	161.84	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052300004809	华海药业	2022 年 5 月 23 日	310,200.00	15,000	14	1.70	205.08	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052300005097	索菲亚	2022 年 5 月 23 日	1,372,150.00	65,000	14	1.70	907.14	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052300005099	美年健康	2022 年 5 月 23 日	866,827.00	170,300	14	1.70	573.07	-	-
兴业证券股份有限公司	2022052300005101	金证股份	2022 年 5 月 23 日	233,760.00	24,000	14	1.70	154.54	-	-
兴业证券股份有限公司	202205230000	中联重科	2022 年 5 月 23 日	1,257,732.00	213,900	14	1.70	831.50	-	-

	5103		日							
兴业证券股份有限公司	202205 230000 5105	金地集团	2022 年 5 月 23 日	547,800. 00	44,000	14	1.70	362.16	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 230000 5107	锦江酒店	2022 年 5 月 23 日	491,700. 00	10,000	14	1.70	325.07	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 230000 5109	华发股份	2022 年 5 月 23 日	287,200. 00	40,000	14	1.70	189.87	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 230000 5111	华海药业	2022 年 5 月 23 日	620,400. 00	30,000	14	1.70	410.15	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 230000 5113	万达电影	2022 年 5 月 23 日	1,267,20 0.00	110,000	14	1.70	837.76	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 230000 5115	川投能源	2022 年 5 月 23 日	933,165. 00	80,100	14	1.70	616.93	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 230000 5117	华侨城 A	2022 年 5 月 23 日	2,356,06 8.00	411,900	14	1.70	1,557. 62	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 250000 0651	碧水源	2022 年 5 月 25 日	405,450. 00	85,000	14	3.40	536.10	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 250000 1451	亨通光电	2022 年 5 月 25 日	1,375,20 0.00	120,000	14	1.70	909.16	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 250000 1672	中牧股份	2022 年 5 月 25 日	214,020. 00	18,000	14	1.70	141.49	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 250000 1806	华域汽车	2022 年 5 月 25 日	1,767,74 6.00	79,700	14	1.70	1,168. 68	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 250000 4725	上海建工	2022 年 5 月 25 日	304,000. 00	100,000	14	1.70	200.98	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 250000 4747	广汇汽车	2022 年 5 月 25 日	286,000. 00	100,000	14	1.70	189.08	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 250000 4813	锦江酒店	2022 年 5 月 25 日	493,500. 00	10,000	14	1.70	326.26	-	-
兴业证券股	202205	开滦股	2022 年	223,800.	30,000	14	1.70	147.96	-	-

份有限公司	250000 4823	份	5 月 25 日	00						
兴业证券股 份有限公司	202205 250000 5251	索菲亚	2022 年 5 月 25 日	310,909. 00	15,100	14	1.70	205.55	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 250000 8211	亚光科 技	2022 年 5 月 25 日	557,000. 00	100,000	14	3.20	693.16	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 250000 8285	禾川科 技	2022 年 5 月 25 日	44,592.0 0	2,400	14	3.40	58.96	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 0566	碧水源	2022 年 5 月 27 日	361,500. 00	75,000	14	3.40	477.98	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 1210	完美世 界	2022 年 5 月 27 日	129,600. 00	10,000	14	1.70	85.68	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 1273	盘江股 份	2022 年 5 月 27 日	273,900. 00	30,000	14	1.70	181.08	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 1305	中国人 寿	2022 年 5 月 27 日	1,244,91 0.00	51,000	14	1.70	823.02	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 2442	TCL 科 技	2022 年 5 月 27 日	543,753. 00	123,300	14	1.70	359.48	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 2538	建发股 份	2022 年 5 月 27 日	926,631. 00	69,100	14	1.70	612.61	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 2540	索菲亚	2022 年 5 月 27 日	213,720. 00	10,400	14	1.70	141.29	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 2542	建发股 份	2022 年 5 月 27 日	1,341,00 0.00	100,000	14	1.70	886.55	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 2576	科伦药 业	2022 年 5 月 27 日	1,406,40 0.00	80,000	14	1.70	929.79	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 2586	三七互 娱	2022 年 5 月 27 日	618,000. 00	30,000	14	1.70	408.57	-	-
兴业证券股 份有限公司	202205 270000 2596	完美世 界	2022 年 5 月 27 日	518,400. 00	40,000	14	1.70	342.72	-	-

兴业证券股份有限公司	202205 270000 2634	广汇汽车	2022 年 5 月 27 日	88,440.0 0	33,000	14	1.70	58.47	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 270000 2714	开滦股份	2022 年 5 月 27 日	80,300.0 0	10,000	14	1.70	53.09	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 270000 2982	中牧股份	2022 年 5 月 27 日	397,935. 00	33,300	14	1.70	263.08	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 270000 2984	中牧股份	2022 年 5 月 27 日	286,800. 00	24,000	14	1.70	189.61	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 270000 4722	碧水源	2022 年 5 月 27 日	530,200. 00	110,000	14	3.40	701.04	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 270000 5290	亚光科技	2022 年 5 月 27 日	2,335,86 0.00	409,800	14	3.20	2,906. 85	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 300000 1223	华润三九	2022 年 5 月 30 日	433,000. 00	10,000	14	1.70	286.26	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 300000 1357	三七互娱	2022 年 5 月 30 日	411,400. 00	20,000	14	1.70	271.98	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 300000 1537	安迪苏	2022 年 5 月 30 日	2,012,52 8.00	211,400	14	1.70	1,330. 50	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 300000 1625	华润双鹤	2022 年 5 月 30 日	700,810. 00	23,000	14	1.70	463.31	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 300000 1628	华润双鹤	2022 年 5 月 30 日	670,340. 00	22,000	14	1.70	443.17	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 300000 1737	上海医药	2022 年 5 月 30 日	357,400. 00	20,000	14	1.70	236.28	-	-
兴业证券股份有限公司	202205 300000 3098	中国神华	2022 年 5 月 30 日	2,204,00 4.00	64,900	14	1.70	1,457. 09	-	-
兴业证券股份有限公司	202206 010000 1650	徐工机械	2022 年 6 月 1 日	1,216,70 0.00	230,000	14	1.70	804.37	-	-
兴业证券股份有限公司	202206 010000	科伦药业	2022 年 6 月 1 日	1,417,50 0.00	81,000	14	1.70	937.13	-	-

	1962									
兴业证券股份 有限公司	202206 010000 2028	康弘药 业	2022 年 6 月 1 日	247,336. 00	17,200	14	1.70	163.52	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 010000 2094	亨通光 电	2022 年 6 月 1 日	755,400. 00	60,000	14	1.70	499.40	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 010000 4052	双汇发 展	2022 年 6 月 1 日	1,937,08 8.00	70,800	14	1.70	1,280. 63	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 3844	盘江股 份	2022 年 6 月 2 日	396,050. 00	44,500	14	1.70	261.83	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 3852	盘江股 份	2022 年 6 月 2 日	1,780,00 0.00	200,000	14	1.70	1,176. 78	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 4030	川投能 源	2022 年 6 月 2 日	1,402,80 0.00	120,000	14	1.70	927.41	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 4458	万达电 影	2022 年 6 月 2 日	1,485,60 0.00	120,000	14	1.70	982.15	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 4466	万达电 影	2022 年 6 月 2 日	742,800. 00	60,000	14	1.70	491.07	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 6192	中牧股 份	2022 年 6 月 2 日	1,980,72 0.00	157,200	14	1.70	1,309. 48	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 7514	王府井	2022 年 6 月 2 日	329,700. 00	14,000	14	1.70	217.97	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 7890	云海金 属	2022 年 6 月 2 日	1,895,00 0.00	100,000	14	1.70	1,252. 81	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 7892	三七互 娱	2022 年 6 月 2 日	1,691,20 0.00	80,000	14	1.70	1,118. 07	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 9778	贵阳银 行	2022 年 6 月 2 日	608,000. 00	100,000	14	1.70	401.96	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 020000 9790	贵阳银 行	2022 年 6 月 2 日	668,800. 00	110,000	14	1.70	442.15	-	-
兴业证券股	202206	完美世	2022 年	510,510.	37,400	14	1.70	337.50	-	-

份有限公司	020001 0964	界	6月2日	00						
兴业证券股 份有限公司	202206 020001 0968	完美世 界	2022年 6月2日	910,455. 00	66,700	14	1.70	601.91	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 020001 3262	云海金 属	2022年 6月2日	2,014,38 5.00	106,300	14	1.70	1,331. 73	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 020001 3266	云海金 属	2022年 6月2日	1,516,00 0.00	80,000	14	1.70	1,002. 24	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 020002 1410	碧水源	2022年 6月2日	485,000. 00	100,000	14	3.20	603.56	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 1304	晶晨股 份	2022年 6月6日	2,066,45 0.00	18,500	14	3.20	2,571. 58	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 1644	康弘药 业	2022年 6月6日	2,010,43 5.00	140,100	14	1.70	1,329. 12	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 1823	东软集 团	2022年 6月6日	2,128,77 0.00	195,300	14	1.70	1,407. 35	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 2062	华域汽 车	2022年 6月6日	1,970,06 5.00	85,100	14	1.70	1,302. 43	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 3412	上海莱 士	2022年 6月6日	224,000. 00	40,000	14	1.70	148.09	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 3550	重庆百 货	2022年 6月6日	738,500. 00	35,000	14	1.70	488.23	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 3554	辽宁成 大	2022年 6月6日	284,600. 00	20,000	14	1.70	188.15	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 4628	建发股 份	2022年 6月6日	1,025,60 0.00	80,000	14	1.70	678.04	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 4662	华发股 份	2022年 6月6日	537,600. 00	80,000	14	1.70	355.41	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 060000 5112	中联重 科	2022年 6月6日	1,216,00 0.00	200,000	14	1.70	803.91	-	-

兴业证券股份 有限公司	202206 060000 5228	招商蛇 口	2022 年 6 月 6 日	2,483,89 7.00	204,100	14	1.70	1,642. 13	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 5230	华润三 九	2022 年 6 月 6 日	1,213,50 0.00	30,000	14	1.70	802.26	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 5880	科伦药 业	2022 年 6 月 6 日	1,276,10 0.00	70,000	14	1.70	843.64	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 5900	巨人网 络	2022 年 6 月 6 日	481,800. 00	55,000	14	1.70	318.52	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 5902	三七互 娱	2022 年 6 月 6 日	1,711,20 0.00	80,000	14	1.70	1,131. 29	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 5908	三七互 娱	2022 年 6 月 6 日	1,069,50 0.00	50,000	14	1.70	707.06	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 5928	康弘药 业	2022 年 6 月 6 日	1,549,80 0.00	108,000	14	1.70	1,024. 59	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6448	云海金 属	2022 年 6 月 6 日	1,987,98 0.00	102,000	14	1.70	1,314. 28	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6554	华海药 业	2022 年 6 月 6 日	278,250. 00	15,000	14	1.70	183.95	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6556	川投能 源	2022 年 6 月 6 日	940,374. 00	80,100	14	1.70	621.69	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6558	华海药 业	2022 年 6 月 6 日	556,500. 00	30,000	14	1.70	367.91	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6560	金证股 份	2022 年 6 月 6 日	245,760. 00	24,000	14	1.70	162.47	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6562	金地集 团	2022 年 6 月 6 日	502,040. 00	44,000	14	1.70	331.90	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6564	金证股 份	2022 年 6 月 6 日	163,840. 00	16,000	14	1.70	108.32	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000	万达电 影	2022 年 6 月 6 日	1,383,80 0.00	110,000	14	1.70	914.85	-	-

	6566									
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6568	华发股 份	2022 年 6 月 6 日	268,800. 00	40,000	14	1.70	177.71	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6570	索菲亚	2022 年 6 月 6 日	1,424,80 0.00	65,000	14	1.70	941.95	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6572	中联重 科	2022 年 6 月 6 日	1,300,51 2.00	213,900	14	1.70	859.78	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6574	云海金 属	2022 年 6 月 6 日	2,079,58 3.00	106,700	14	1.70	1,374. 84	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6576	美年健 康	2022 年 6 月 6 日	848,094. 00	170,300	14	1.70	560.68	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6578	华侨城 A	2022 年 6 月 6 日	2,290,16 4.00	411,900	14	1.70	1,514. 05	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6966	金 融 街	2022 年 6 月 6 日	232,800. 00	40,000	14	1.70	153.91	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 6976	盘江股 份	2022 年 6 月 6 日	452,500. 00	50,000	14	1.70	299.15	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060000 7276	淮北矿 业	2022 年 6 月 6 日	776,500. 00	50,000	14	1.70	513.35	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 060001 0846	碧水源	2022 年 6 月 6 日	589,200. 00	120,000	14	3.20	733.23	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 080000 0971	碧水源	2022 年 6 月 8 日	242,000. 00	50,000	14	3.40	319.98	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 080000 0972	华大基 因	2022 年 6 月 8 日	247,123. 00	3,700	14	3.40	326.75	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 080000 1616	巨人网 络	2022 年 6 月 8 日	272,800. 00	31,000	14	1.70	180.35	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 080000 1689	上海建 工	2022 年 6 月 8 日	122,800. 00	40,000	14	1.70	81.18	-	-
兴业证券股	202206	通威股	2022 年	1,011,20	20,000	14	1.70	668.52	-	-

份有限公司	080000 1693	份	6月8日	0.00						
兴业证券股 份有限公司	202206 080000 1707	淮北矿 业	2022年 6月8日	1,324,68 0.00	84,000	14	1.70	875.76	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 080000 1845	东软集 团	2022年 6月8日	106,300. 00	10,000	14	1.70	70.28	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 080000 4103	开滦股 份	2022年 6月8日	240,000. 00	30,000	14	1.70	158.67	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 080000 4477	华域汽 车	2022年 6月8日	1,797,23 5.00	79,700	14	1.70	1,188. 17	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 080000 4619	锦江酒 店	2022年 6月8日	534,800. 00	10,000	14	1.70	353.56	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 080000 4957	上海建 工	2022年 6月8日	307,000. 00	100,000	14	1.70	202.96	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 080000 5185	广汇汽 车	2022年 6月8日	280,000. 00	100,000	14	1.70	185.11	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 080000 5273	亨通光 电	2022年 6月8日	1,534,80 0.00	120,000	14	1.70	1,014. 67	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 080000 6841	亚光科 技	2022年 6月8日	607,000. 00	100,000	14	3.20	755.38	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 100000 0766	碧水源	2022年 6月10 日	387,200. 00	80,000	14	3.40	511.96	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 100000 0859	中联重 科	2022年 6月10 日	956,800. 00	160,000	14	1.70	632.55	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 100000 0935	云海金 属	2022年 6月10 日	268,710. 00	13,000	14	1.70	177.65	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 100000 1829	盘江股 份	2022年 6月10 日	292,800. 00	30,000	14	1.70	193.57	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 100000 1841	建发股 份	2022年 6月10 日	1,398,00 0.00	100,000	14	1.70	924.23	-	-

兴业证券股份有限公司	2022061000001843	建发股份	2022 年 6 月 10 日	966,018.00	69,100	14	1.70	638.65	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000001891	索菲亚	2022 年 6 月 10 日	216,736.00	10,400	14	1.70	143.29	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000002047	开滦股份	2022 年 6 月 10 日	81,700.00	10,000	14	1.70	54.01	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000002441	中国人寿	2022 年 6 月 10 日	1,308,660.00	51,000	14	1.70	865.17	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000002669	TCL 科技	2022 年 6 月 10 日	528,957.00	123,300	14	1.70	349.70	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000002679	完美世界	2022 年 6 月 10 日	142,000.00	10,000	14	1.70	93.88	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000002685	科伦药业	2022 年 6 月 10 日	1,489,600.00	80,000	14	1.70	984.79	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000002693	三七互娱	2022 年 6 月 10 日	678,900.00	30,000	14	1.70	448.83	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000002699	完美世界	2022 年 6 月 10 日	568,000.00	40,000	14	1.70	375.51	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000002833	广汇汽车	2022 年 6 月 10 日	89,760.00	33,000	14	1.70	59.34	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000003669	碧水源	2022 年 6 月 10 日	532,400.00	110,000	14	3.40	703.95	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000003671	碧水源	2022 年 6 月 10 日	363,000.00	75,000	14	3.40	479.97	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061000004139	亚光科技	2022 年 6 月 10 日	2,442,408.00	409,800	14	3.20	3,039.44	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061300003701	徐工机械	2022 年 6 月 13 日	529,000.00	100,000	14	1.70	349.73	-	-
兴业证券股份有限公司	202206130000	美年健康	2022 年 6 月 13 日	2,080,512.00	403,200	14	1.70	1,375.45	-	-

	4749		日							
兴业证券股份 有限公司	202206 130000 7443	东软集 团	2022 年 6 月 13 日	2,032,56 4.00	188,900	14	1.70	1,343. 75	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 130000 8354	华友钴 业	2022 年 6 月 13 日	1,700,40 0.00	20,000	14	1.70	1,124. 15	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 130001 6699	华润双 鹤	2022 年 6 月 13 日	497,260. 00	23,000	14	1.70	328.74	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 130001 7239	上海医 药	2022 年 6 月 13 日	357,600. 00	20,000	14	1.70	236.41	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 130001 7243	安迪苏	2022 年 6 月 13 日	2,128,79 8.00	211,400	14	1.70	1,407. 37	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 130001 7295	华润三 九	2022 年 6 月 13 日	423,000. 00	10,000	14	1.70	279.65	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 130001 7329	中国神 华	2022 年 6 月 13 日	2,189,07 7.00	64,900	14	1.70	1,447. 22	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 150000 5040	徐工机 械	2022 年 6 月 15 日	537,000. 00	100,000	14	1.70	355.02	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 150000 7730	索菲亚	2022 年 6 月 15 日	432,480. 00	20,400	14	1.70	285.92	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 150000 8040	通宇通 讯	2022 年 6 月 15 日	2,010,80 1.00	183,300	14	1.70	1,329. 36	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 150001 0301	华润双 鹤	2022 年 6 月 15 日	515,250. 00	25,000	14	1.70	340.64	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 150002 0753	徐工机 械	2022 年 6 月 15 日	1,235,10 0.00	230,000	14	1.70	816.54	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 150002 0791	双汇发 展	2022 年 6 月 15 日	2,034,08 4.00	70,800	14	1.70	1,344. 76	-	-
兴业证券股份 有限公司	202206 150002 0837	科伦药 业	2022 年 6 月 15 日	1,500,93 0.00	81,000	14	1.70	992.28	-	-
兴业证券股	202206	亨通光	2022 年	772,800.	60,000	14	1.70	510.91	-	-

份有限公司	150002 1245	电	6 月 15 日	00						
兴业证券股 份有限公司	202206 150002 2341	康弘药 业	2022 年 6 月 15 日	246,992. 00	17,200	14	1.70	163.29	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 5947	三七互 娱	2022 年 6 月 16 日	1,828,80 0.00	80,000	14	1.70	1,209. 04	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 5951	云海金 属	2022 年 6 月 16 日	2,157,00 0.00	100,000	14	1.70	1,426. 02	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 6843	云海金 属	2022 年 6 月 16 日	1,725,60 0.00	80,000	14	1.70	1,140. 81	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 6845	云海金 属	2022 年 6 月 16 日	2,292,89 1.00	106,300	14	1.70	1,515. 86	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 8047	王府井	2022 年 6 月 16 日	327,600. 00	14,000	14	1.70	216.58	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 8149	贵阳银 行	2022 年 6 月 16 日	594,000. 00	100,000	14	1.70	392.70	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 8159	贵阳银 行	2022 年 6 月 16 日	653,400. 00	110,000	14	1.70	431.97	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 8293	万达电 影	2022 年 6 月 16 日	1,486,80 0.00	120,000	14	1.70	982.94	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 8393	中牧股 份	2022 年 6 月 16 日	2,012,16 0.00	157,200	14	1.70	1,330. 26	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 8439	盘江股 份	2022 年 6 月 16 日	1,812,00 0.00	200,000	14	1.70	1,197. 93	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 8441	盘江股 份	2022 年 6 月 16 日	403,170. 00	44,500	14	1.70	266.54	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 9601	完美世 界	2022 年 6 月 16 日	980,490. 00	66,700	14	1.70	648.21	-	-
兴业证券股 份有限公司	202206 160000 9603	完美世 界	2022 年 6 月 16 日	549,780. 00	37,400	14	1.70	363.47	-	-

兴业证券股份有限公司	2022061600016389	碧水源	2022 年 6 月 16 日	496,000.00	100,000	14	3.20	617.24	-	-
兴业证券股份有限公司	2022061700003745	云海金属	2022 年 6 月 17 日	2,274,272.00	100,100	14	1.70	1,503.55	2,510,508.00	1,396.20
兴业证券股份有限公司	2022061700005030	贵阳银行	2022 年 6 月 17 日	1,186,000.00	200,000	14	1.70	784.08	1,162,000.00	728.13
兴业证券股份有限公司	2022062000002375	云海金属	2022 年 6 月 20 日	1,341,000.00	60,000	14	1.70	886.55	1,504,800.00	633.30
兴业证券股份有限公司	2022062000002391	金风科技	2022 年 6 月 20 日	139,300.00	10,000	14	1.70	92.09	148,000.00	65.80
兴业证券股份有限公司	2022062000002820	中南传媒	2022 年 6 月 20 日	1,341,200.00	140,000	14	1.70	886.68	1,321,600.00	633.30
兴业证券股份有限公司	2022062000007006	金融街	2022 年 6 月 20 日	231,600.00	40,000	14	1.70	153.11	238,000.00	109.40
兴业证券股份有限公司	2022062000007284	盘江股份	2022 年 6 月 20 日	433,500.00	50,000	14	1.70	286.59	438,500.00	204.70
兴业证券股份有限公司	2022062000007292	云海金属	2022 年 6 月 20 日	2,279,700.00	102,000	14	1.70	1,507.14	2,558,160.00	1,076.50
兴业证券股份有限公司	2022062000007346	巨人网络	2022 年 6 月 20 日	484,550.00	55,000	14	1.70	320.34	503,250.00	228.80
兴业证券股份有限公司	2022062000008272	华海药业	2022 年 6 月 20 日	325,500.00	15,000	14	1.70	215.19	340,500.00	153.70
兴业证券股份有限公司	2022062000009558	中联重科	2022 年 6 月 20 日	1,222,000.00	200,000	14	1.70	807.88	1,232,000.00	577.10
兴业证券股份有限公司	2022062000009560	科伦药业	2022 年 6 月 20 日	1,348,200.00	70,000	14	1.70	891.31	1,309,000.00	636.70
兴业证券股份有限公司	2022062000009562	招商蛇口	2022 年 6 月 20 日	2,541,045.00	204,100	14	1.70	1,679.91	2,741,063.00	1,199.90
兴业证券股份有限公司	202206200000	华润三九	2022 年 6 月 20 日	1,213,500.00	30,000	14	1.70	802.26	1,350,000.00	573.00

	9564		日							
兴业证券股份 有限公司	202206 200000 9566	中联重 科	2022 年 6 月 20 日	1,306,92 9.00	213,900	14	1.70	864.03	1,317, 624.00	617.20
兴业证券股份 有限公司	202206 200000 9568	华侨城 A	2022 年 6 月 20 日	2,347,83 0.00	411,900	14	1.70	1,552. 18	2,673, 231.00	1,108.7 0
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0632	淮北矿 业	2022 年 6 月 20 日	690,500. 00	50,000	14	1.70	456.50	728,00 0.00	326.10
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0634	华域汽 车	2022 年 6 月 20 日	1,987,93 6.00	85,100	14	1.70	1,314. 25	1,957, 300.00	938.70
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0636	辽宁成 大	2022 年 6 月 20 日	299,200. 00	20,000	14	1.70	197.80	291,60 0.00	141.30
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0638	华海药 业	2022 年 6 月 20 日	651,000. 00	30,000	14	1.70	430.38	681,00 0.00	307.40
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0640	东软集 团	2022 年 6 月 20 日	2,101,42 8.00	195,300	14	1.70	1,389. 28	2,247, 903.00	992.30
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0642	金证股 份	2022 年 6 月 20 日	165,600. 00	16,000	14	1.70	109.48	166,08 0.00	78.20
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0644	川投能 源	2022 年 6 月 20 日	954,792. 00	80,100	14	1.70	631.22	954,79 2.00	450.90
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0646	金证股 份	2022 年 6 月 20 日	248,400. 00	24,000	14	1.70	164.22	249,12 0.00	117.30
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0648	建发股 份	2022 年 6 月 20 日	1,036,80 0.00	80,000	14	1.70	685.44	1,045, 600.00	489.60
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0650	金地集 团	2022 年 6 月 20 日	546,920. 00	44,000	14	1.70	361.57	591,36 0.00	258.30
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0652	万达电 影	2022 年 6 月 20 日	1,399,20 0.00	110,000	14	1.70	925.03	1,501, 500.00	660.70
兴业证券股份 有限公司	202206 200001 0654	华发股 份	2022 年 6 月 20 日	552,000. 00	80,000	14	1.70	364.93	605,60 0.00	260.70
兴业证券股	202206	三七互	2022 年	1,840,80	80,000	14	1.70	1,216.	1,698,	869.30

份有限公司	200001 0656	娱	6 月 20 日	0.00				97	400.00	
兴业证券股 份有限公司	202206 200001 0658	上海莱 士	2022 年 6 月 20 日	244,000. 00	40,000	14	1.70	161.31	237,20 0.00	115.20
兴业证券股 份有限公司	202206 200001 0660	三七互 娱	2022 年 6 月 20 日	1,150,50 0.00	50,000	14	1.70	760.61	1,061, 500.00	543.30
兴业证券股 份有限公司	202206 200001 0662	云海金 属	2022 年 6 月 20 日	2,384,74 5.00	106,700	14	1.70	1,576. 58	2,676, 036.00	1,126.1 0
兴业证券股 份有限公司	202206 200001 0664	美年健 康	2022 年 6 月 20 日	911,105. 00	170,300	14	1.70	602.34	948,57 1.00	430.20
兴业证券股 份有限公司	202206 200001 0872	康弘药 业	2022 年 6 月 20 日	2,091,69 3.00	140,100	14	1.70	1,382. 84	2,093, 094.00	987.70
兴业证券股 份有限公司	202206 200001 0916	重庆百 货	2022 年 6 月 20 日	735,350. 00	35,000	14	1.70	486.15	754,95 0.00	347.20
兴业证券股 份有限公司	202206 200001 4540	晶晨股 份	2022 年 6 月 20 日	1,850,00 0.00	18,500	14	3.20	2,302. 22	1,868, 500.00	1,644.4 0
兴业证券股 份有限公司	202206 200001 4542	碧水源	2022 年 6 月 20 日	591,600. 00	120,000	14	3.20	736.21	625,20 0.00	525.90
兴业证券股 份有限公司	202206 220000 3148	格力电 器	2022 年 6 月 22 日	2,569,60 0.00	80,000	14	1.70	1,698. 79	2,697, 600.00	970.72
兴业证券股 份有限公司	202206 220000 3150	格力电 器	2022 年 6 月 22 日	2,569,60 0.00	80,000	14	1.70	1,698. 79	2,697, 600.00	970.72
兴业证券股 份有限公司	202206 220000 3777	云海金 属	2022 年 6 月 22 日	763,700. 00	35,000	14	1.70	504.89	877,80 0.00	288.48
兴业证券股 份有限公司	202206 220000 4696	淮北矿 业	2022 年 6 月 22 日	187,740. 00	14,000	14	1.70	124.12	203,84 0.00	70.96
兴业证券股 份有限公司	202206 220000 5630	锦江酒 店	2022 年 6 月 22 日	672,360. 00	12,000	14	1.70	444.50	754,80 0.00	254.00
兴业证券股 份有限公司	202206 220001 0267	淮北矿 业	2022 年 6 月 22 日	1,126,44 0.00	84,000	14	1.70	744.70	1,223, 040.00	425.52

兴业证券股份有限公司	2022062200010585	开滦股份	2022 年 6 月 22 日	212,100.00	30,000	14	1.70	140.22	228,600.00	80.16
兴业证券股份有限公司	2022062200010633	上海建工	2022 年 6 月 22 日	302,000.00	100,000	14	1.70	199.66	303,000.00	114.08
兴业证券股份有限公司	2022062200010689	东软集团	2022 年 6 月 22 日	107,200.00	10,000	14	1.70	70.87	115,100.00	40.48
兴业证券股份有限公司	2022062200010743	上海建工	2022 年 6 月 22 日	120,800.00	40,000	14	1.70	79.86	121,200.00	45.60
兴业证券股份有限公司	2022062200012107	广汇汽车	2022 年 6 月 22 日	271,000.00	100,000	14	1.70	179.16	261,000.00	102.40
兴业证券股份有限公司	2022062200012183	锦江酒店	2022 年 6 月 22 日	560,300.00	10,000	14	1.70	370.42	629,000.00	211.68
兴业证券股份有限公司	2022062200012185	华域汽车	2022 年 6 月 22 日	1,849,837.00	79,700	14	1.70	1,222.95	1,833,100.00	698.80
兴业证券股份有限公司	2022062200012347	亨通光电	2022 年 6 月 22 日	1,682,400.00	120,000	14	1.70	1,112.25	1,744,800.00	635.60
兴业证券股份有限公司	2022062200013105	亚光科技	2022 年 6 月 22 日	601,000.00	100,000	14	3.20	747.91	620,000.00	427.36
兴业证券股份有限公司	2022062200013359	碧水源	2022 年 6 月 22 日	240,500.00	50,000	14	3.40	317.99	260,500.00	181.68
兴业证券股份有限公司	2022062400001268	芒果超媒	2022 年 6 月 24 日	416,020.00	12,400	14	3.20	517.71	413,664.00	221.88
兴业证券股份有限公司	2022062400002084	三花智控	2022 年 6 月 24 日	251,000.00	10,000	14	1.70	165.94	274,800.00	71.10
兴业证券股份有限公司	2022062400002772	陕西煤业	2022 年 6 月 24 日	1,026,676.00	51,800	14	1.70	678.75	1,097,124.00	290.88
兴业证券股份有限公司	2022062400003665	中国铁建	2022 年 6 月 24 日	932,400.00	120,000	14	1.70	616.42	948,000.00	264.18
兴业证券股份有限公司	202206240000	科伦药业	2022 年 6 月 24 日	1,553,600.00	80,000	14	1.70	1,027.10	1,496,000.00	440.16

	6590		日							
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6598	三七互 娱	2022 年 6 月 24 日	642,900. 00	30,000	14	1.70	425.03	636,90 0.00	182.16
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6602	完美世 界	2022 年 6 月 24 日	139,600. 00	10,000	14	1.70	92.29	143,70 0.00	39.54
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6604	完美世 界	2022 年 6 月 24 日	558,400. 00	40,000	14	1.70	369.16	574,80 0.00	158.22
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6626	广汇汽 车	2022 年 6 月 24 日	88,110.0 0	33,000	14	1.70	58.25	86,130 .00	24.96
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6676	开滦股 份	2022 年 6 月 24 日	72,000.0 0	10,000	14	1.70	47.60	76,200 .00	20.40
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6690	中国人 寿	2022 年 6 月 24 日	1,620,27 0.00	51,000	14	1.70	1,071. 18	1,585, 080.00	459.06
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6728	索菲亚	2022 年 6 月 24 日	276,224. 00	10,400	14	1.70	182.61	286,00 0.00	78.24
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6730	盘江股 份	2022 年 6 月 24 日	255,900. 00	30,000	14	1.70	169.18	263,10 0.00	72.48
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6732	建发股 份	2022 年 6 月 24 日	812,616. 00	69,100	14	1.70	537.23	903,13 7.00	230.22
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6734	建发股 份	2022 年 6 月 24 日	1,176,00 0.00	100,000	14	1.70	777.47	1,307, 000.00	333.18
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 6736	中联重 科	2022 年 6 月 24 日	955,200. 00	160,000	14	1.70	631.49	985,60 0.00	270.66
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 7146	TCL 科 技	2022 年 6 月 24 日	552,384. 00	123,300	14	1.70	365.19	590,60 7.00	156.48
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 7956	碧水源	2022 年 6 月 24 日	392,000. 00	80,000	14	3.40	518.31	416,80 0.00	222.12
兴业证券股份 有限公司	202206 240000 7978	碧水源	2022 年 6 月 24 日	539,000. 00	110,000	14	3.40	712.68	573,10 0.00	305.46
兴业证券股	202206	碧水源	2022 年	367,500.	75,000	14	3.40	485.92	390,75	208.26

份有限公司	2400007980		6 月 24 日	00					0.00	
兴业证券股 份有限公司	2022062400008580	亚光科 技	2022 年 6 月 24 日	2,528,466.00	409,800	14	3.20	3,146.54	2,540,760.00	1,348.50
兴业证券股 份有限公司	2022062700001111	华大基 因	2022 年 6 月 27 日	276,360.00	4,000	14	3.20	343.91	286,800.00	73.71
兴业证券股 份有限公司	2022062700001301	格力电 器	2022 年 6 月 27 日	3,990,000.00	120,000	14	1.70	2,637.83	4,046,400.00	565.26
兴业证券股 份有限公司	2022062700001878	通威股 份	2022 年 6 月 27 日	575,500.00	10,000	14	1.70	380.47	598,600.00	81.54
兴业证券股 份有限公司	2022062700008756	上海医 药	2022 年 6 月 27 日	364,800.00	20,000	14	1.70	241.17	361,600.00	51.69
兴业证券股 份有限公司	2022062700008758	中国神 华	2022 年 6 月 27 日	2,104,058.00	64,900	14	1.70	1,391.02	2,161,170.00	298.08
兴业证券股 份有限公司	2022062700008760	东软集 团	2022 年 6 月 27 日	2,106,235.00	188,900	14	1.70	1,392.46	2,174,239.00	298.38
兴业证券股 份有限公司	2022062700008762	华润三 九	2022 年 6 月 27 日	440,900.00	10,000	14	1.70	291.48	450,000.00	62.46
兴业证券股 份有限公司	2022062700008764	安迪苏	2022 年 6 月 27 日	2,044,238.00	211,400	14	1.70	1,351.47	2,025,212.00	289.59
兴业证券股 份有限公司	2022062700008766	徐工机 械	2022 年 6 月 27 日	536,000.00	100,000	14	1.70	354.36	539,000.00	75.93
兴业证券股 份有限公司	2022062700008768	美年健 康	2022 年 6 月 27 日	2,108,736.00	403,200	14	1.70	1,394.11	2,245,824.00	298.74
兴业证券股 份有限公司	2022062700011442	华润双 鹤	2022 年 6 月 27 日	521,410.00	23,000	14	1.70	344.71	590,180.00	73.86
兴业证券股 份有限公司	2022062900003665	通宇通 讯	2022 年 6 月 29 日	2,880,000.00	240,000	14	1.70	1,904.00	2,894,400.00	136.00
兴业证券股 份有限公司	2022062900009012	科伦药 业	2022 年 6 月 29 日	1,502,550.00	81,000	14	1.70	993.35	1,514,700.00	70.95

兴业证券股份有限公司	2022062900009080	通宇通讯	2022 年 6 月 29 日	2,199,600.00	183,300	14	1.70	1,454.18	2,210,598.00	103.87
兴业证券股份有限公司	2022062900009542	索菲亚	2022 年 6 月 29 日	554,880.00	20,400	14	1.70	366.84	561,000.00	26.20
兴业证券股份有限公司	2022062900011050	徐工机械	2022 年 6 月 29 日	1,237,400.00	230,000	14	1.70	818.06	1,239,700.00	58.43
兴业证券股份有限公司	2022062900012832	双汇发展	2022 年 6 月 29 日	2,027,712.00	70,800	14	1.70	1,340.54	2,074,440.00	95.75
兴业证券股份有限公司	2022062900015016	华润双鹤	2022 年 6 月 29 日	608,000.00	25,000	14	1.70	401.96	641,500.00	28.71
兴业证券股份有限公司	2022062900020578	亨通光电	2022 年 6 月 29 日	837,000.00	60,000	14	1.70	553.35	872,400.00	39.53
兴业证券股份有限公司	2022063000010213	云海金属	2022 年 6 月 30 日	2,666,004.00	106,300	14	1.70	1,762.52	2,666,004.00	-
兴业证券股份有限公司	2022063000010219	云海金属	2022 年 6 月 30 日	2,006,400.00	80,000	14	1.70	1,326.45	2,006,400.00	-
兴业证券股份有限公司	2022063000011257	云海金属	2022 年 6 月 30 日	2,508,000.00	100,000	14	1.70	1,658.07	2,508,000.00	-
兴业证券股份有限公司	2022063000011259	完美世界	2022 年 6 月 30 日	537,438.00	37,400	14	1.70	355.31	537,438.00	-
兴业证券股份有限公司	2022063000011263	完美世界	2022 年 6 月 30 日	958,479.00	66,700	14	1.70	633.66	958,479.00	-
兴业证券股份有限公司	2022063000011943	万达电影	2022 年 6 月 30 日	1,638,000.00	120,000	14	1.70	1,082.90	1,638,000.00	-
兴业证券股份有限公司	2022063000011981	中牧股份	2022 年 6 月 30 日	1,927,272.00	157,200	14	1.70	1,274.14	1,927,272.00	-
兴业证券股份有限公司	2022063000012033	盘江股份	2022 年 6 月 30 日	390,265.00	44,500	14	1.70	258.01	390,265.00	-
兴业证券股份有限公司	202206300001	盘江股份	2022 年 6 月 30 日	1,754,000.00	200,000	14	1.70	1,159.59	1,754,000.00	-

	2035		日							
兴业证券股份有限公司	2022063000013407	贵阳银行	2022 年 6 月 30 日	639,100.00	110,000	14	1.70	422.52	639,100.00	-
兴业证券股份有限公司	2022063000021259	碧水源	2022 年 6 月 30 日	521,000.00	100,000	14	3.20	648.36	521,000.00	-
上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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：本报告期内基金管理人均未运用固有资金投资本基金

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 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
招商银行	106,833.10	1,100.95	68,609,127.22	692,719.07

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金报告内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022 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
002730	电光科技	2022 年 1 月 18 日	6 个月	非公开发行流通受限	9.51	8.37	841,220	8,000,002.20	7,041,011.40	-
300353	东土科技	2022 年 1 月 14 日	6 个月	非公开发行流通受限	7.90	8.74	2,531,646	20,000,003.40	22,126,586.04	-
300383	光环新网	2021 年 12 月 29 日	6 个月	非公开发行流通受限	11.79	10.42	1,526,717	17,999,993.43	15,908,391.14	-
300506	名家汇	2021 年 12 月 28 日	6 个月	非公开发行流通受限	6.30	6.77	2,380,952	14,999,997.60	16,119,045.04	-
300511	雪榕生物	2022 年 3 月 18 日	6 个月	非公开发行流通受限	6.06	6.31	2,277,228	13,800,001.68	14,369,308.68	-
300647	超频三	2022 年 6 月 29 日	6 个月	非公开发行流通受限	7.49	10.27	1,695,593	12,699,991.57	17,413,740.11	-
300674	宇信科技	2022 年 2 月 7 日	6 个月	非公开发行流通受限	22.10	15.27	135,747	3,000,008.70	2,072,856.69	-
300695	兆丰股份	2022 年 1 月	6 个月	非公开发	54.09	51.43	129,414	7,000,003.26	6,655,762.02	-

		24 日		行流通受限						
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301102	兆讯传媒	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	42.50	32.02	390	16,575.00	12,487.80	-
301103	何氏眼科	2022 年 6 月 1 日	3-4 个月	新股流通受限-转增	-	32.02	117	-	3,746.34	注 1
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	34.81	16.14	1,225	42,642.25	19,771.50	-
301109	军信股份	2022 年 6 月 17 日	3-4 个月	新股流通受限-转增	-	16.14	612	-	9,877.68	注 2
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	163.56	82.76	58	9,486.48	4,800.08	-
301150	中一科技	2022 年 6 月 10 日	4-5 个月	新股流通受限-转增	-	82.76	29	-	2,400.04	注 3
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301163	宏德股份	2022 年 4 月	6 个月	新股流通	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-

		11 日		受限						
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内(含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新股流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301268	铭利	2022	6 个月	新股	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-

	达	年 3 月 29 日		流通 受限						
301286	侨源 股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新股 流通 受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301288	清研 环境	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股 流通 受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
600938	中国 海油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股 流通 受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
603041	美思 德	2022 年 4 月 29 日	6 个月	非公 开发 行流 通受 限	10.08	11.80	694,444	6,999,995.52	8,194,439.20	-
688209	英集 芯	2022 年 4 月 12 日	6 个月	新股 流通 受限	24.23	27.58	6,822	165,297.06	188,150.76	-
688237	超卓 航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688322	奥比 中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
688400	凌云 光	2022 年 6 月 27 日	1 个月 内(含)	新股 流通 受限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

注：1、本基金持有的新股流通受限股票何氏眼科，于 2022 年 6 月 1 日实施 2021 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 6.00 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股。本基金新增 117 股。

2、本基金持有的新股流通受限股票军信股份，于 2022 年 6 月 17 日实施 2021 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 3.80 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股。本基金新增 612 股。

3、本基金持有的新股流通受限股票中一科技，于 2022 年 6 月 10 日实施 2021 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 20.00 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股。本基金新增 29 股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 43,761,350.37 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
190407	19 农发 07	2022 年 7 月 4 日	103.04	45,000	4,636,945.48
220404	22 农发 04	2022 年 7 月 4 日	99.92	90,000	8,993,095.89
210212	21 国开 12	2022 年 7 月 5 日	101.77	113,000	11,500,010.00
190407	19 农发 07	2022 年 7 月 6 日	103.04	31,000	3,194,340.22
210212	21 国开 12	2022 年 7 月 6 日	101.77	74,000	7,530,980.00
220404	22 农发 04	2022 年 7 月 7 日	99.92	110,000	10,991,561.64
合计				463,000	46,846,933.23

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 39,356,613.20 元，于 2022 年 7 月 4 日、2022 年 7 月 5 日、2022 年 7 月 6 日、2022 年 7 月 11 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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	000069	华侨城 A	2022 年 7 月 4 日	6.49	411,900	2,673,231.00
2	000100	TCL 科技	2022 年 7 月 8 日	4.79	123,300	590,607.00
3	000157	中联重科	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 8 日	6.16	573,900	3,535,224.00
4	000402	金融街	2022 年 7 月 4 日	5.95	40,000	238,000.00

5	000425	徐工机械	2022 年 7 月 11 日-2022 年 7 月 13 日	5.39	330,000	1,778,700.00
6	000651	格力电器	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 11 日	33.72	280,000	9,441,600.00
7	000895	双汇发展	2022 年 7 月 13 日	29.30	70,800	2,074,440.00
8	000999	华润三九	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 11 日	45.00	40,000	1,800,000.00
9	001979	招商蛇口	2022 年 7 月 4 日	13.43	204,100	2,741,063.00
10	002044	美年健康	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 11 日	5.57	573,500	3,194,395.00
11	002050	三花智控	2022 年 7 月 8 日	27.48	10,000	274,800.00
12	002182	云海金属	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 14 日	25.08	690,100	17,307,708.00
13	002202	金风科技	2022 年 7 月 4 日	14.80	10,000	148,000.00
14	002252	上海莱士	2022 年 7 月 4 日	5.93	40,000	237,200.00
15	002422	科伦药业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 13 日	18.70	231,000	4,319,700.00
16	002555	三七互娱	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 8 日	21.23	160,000	3,396,800.00
17	002558	巨人网络	2022 年 7 月 4 日	9.15	55,000	503,250.00
18	002572	索菲亚	2022 年 7 月 8 日-2022 年 7 月 13 日	27.50	30,800	847,000.00
19	002624	完美世界	2022 年 7 月 8 日-2022 年 7 月 14 日	14.37	154,100	2,214,417.00
20	002739	万达电影	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	13.65	230,000	3,139,500.00
21	002773	康弘药业	2022 年 7 月 4 日	14.94	140,100	2,093,094.00
22	002792	通宇通讯	2022 年 7 月 13 日-2022 年 7 月 13 日	12.06	423,300	5,104,998.00
23	300070	碧水源	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	5.21	535,000	2,787,350.00
24	300123	亚光科技	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 8 日	6.20	509,800	3,160,760.00
25	300413	芒果超媒	2022 年 7 月 8 日	33.36	12,400	413,664.00
26	300676	华大基因	2022 年 7 月 11 日	71.70	4,000	286,800.00

27	600062	华润双鹤	2022 年 7 月 11 日-2022 年 7 月 13 日	25.66	48,000	1,231,680.00
28	600153	建发股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 8 日	13.07	249,100	3,255,737.00
29	600170	上海建工	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 6 日	3.03	140,000	424,200.00
30	600195	中牧股份	2022 年 7 月 14 日	12.26	157,200	1,927,272.00
31	600297	广汇汽车	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 8 日	2.61	133,000	347,130.00
32	600299	安迪苏	2022 年 7 月 11 日	9.58	211,400	2,025,212.00
33	600325	华发股份	2022 年 7 月 4 日	7.57	80,000	605,600.00
34	600383	金地集团	2022 年 7 月 4 日	13.44	44,000	591,360.00
35	600395	盘江股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	8.77	324,500	2,845,865.00
36	600438	通威股份	2022 年 7 月 11 日	59.86	10,000	598,600.00
37	600446	金证股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 4 日	10.38	40,000	415,200.00
38	600487	亨通光电	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	14.54	180,000	2,617,200.00
39	600521	华海药业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 4 日	22.70	45,000	1,021,500.00
40	600674	川投能源	2022 年 7 月 4 日	11.92	80,100	954,792.00
41	600718	东软集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 11 日	11.51	394,200	4,537,242.00
42	600729	重庆百货	2022 年 7 月 4 日	21.57	35,000	754,950.00
43	600739	辽宁成大	2022 年 7 月 4 日	14.58	20,000	291,600.00
44	600741	华域汽车	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 6 日	23.00	164,800	3,790,400.00
45	600754	锦江酒店	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 6 日	62.90	22,000	1,383,800.00
46	600985	淮北矿业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 6 日	14.56	148,000	2,154,880.00
47	600997	开滦股份	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 8 日	7.62	40,000	304,800.00
48	601088	中国神华	2022 年 7 月 11 日	33.30	64,900	2,161,170.00

49	601098	中南传媒	2022 年 7 月 4 日	9.44	140,000	1,321,600.00
50	601186	中国铁建	2022 年 7 月 8 日	7.90	120,000	948,000.00
51	601225	陕西煤业	2022 年 7 月 8 日	21.18	51,800	1,097,124.00
52	601607	上海医药	2022 年 7 月 11 日	18.08	20,000	361,600.00
53	601628	中国人寿	2022 年 7 月 8 日	31.08	51,000	1,585,080.00
54	601997	贵阳银行	2022 年 7 月 1 日-2022 年 7 月 14 日	5.81	310,000	1,801,100.00
55	688099	晶晨股份	2022 年 7 月 4 日	101.00	18,500	1,868,500.00
合计	-	-	-	-	9,225,600	117,525,495.00

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

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

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部及合规管理部和审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	47,834,605.98	17,745,045.40
AAA 以下	5,219,905.14	3,890,503.10
未评级	—	—
合计	53,054,511.12	21,635,548.50

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持大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，因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。

本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	106,833.10	-	-	-	-	-	106,833.10
结算备付金	1,842,909.35	-	-	-	-	-	1,842,909.35
存出保证金	66,174.75	-	-	-	-	-	66,174.75
交易性金融资产	20,608,646.58	5,121,449.32	62,541,430.95	43,689,373.79	9,365,137.33	1,473,715,403.50	1,615,041,441.47
买入返售金融资产	14,500,000.00	-	-	-	-	-	14,500,000.00
应收申购款	1,234.87	-	-	-	-	108,288.28	109,523.15
应收清算款	-	-	-	-	-	5,968,595.42	5,968,595.42
其他资产	-	-	-	-	-	35,198.29	35,198.29
资产总计	37,125,798.	5,121,449	62,541,430.	43,689,3	9,365,137	1,479,827	1,637,670,

	65	. 32	95	73. 79	. 33	, 485. 49	675. 53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	23, 718, 503. 99	23, 718, 503. 99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1, 332, 676. 87	1, 332, 676. 87
应付托管费	-	-	-	-	-	181, 728. 67	181, 728. 67
应付清算款	-	-	-	-	-	2, 490, 538. 99	2, 490, 538. 99
卖出回购金融资产款	83, 117, 963. 57	-	-	-	-	-	83, 117, 963. 57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	47, 272. 90	47, 272. 90
应交税费	-	-	-	-	-	5, 006. 89	5, 006. 89
其他负债	-	-	-	-	-	496, 059. 09	496, 059. 09
负债总计	83, 117, 963. 57	-	-	-	-	28, 271, 787. 40	111, 389, 750. 97
利率敏感度缺口	-45, 992, 164. 92	5, 121, 449. 32	62, 541, 430. 95	43, 689, 373. 79	9, 365, 137. 33	1, 451, 555. 698. 09	1, 526, 280, 924. 56
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	509, 792. 95	-	-	-	-	-	509, 792. 95
结算备付金	3, 114, 250. 36	-	-	-	-	-	3, 114, 250. 36
存出保证金	362, 019. 26	-	-	-	-	-	362, 019. 26
交易性金融资产	12, 002, 400. 00	2, 002, 400. 00	82, 282, 400. 00	3, 509, 400. 00	18, 126, 148. 50	1, 832, 300. 496. 37	1, 950, 223, 244. 87
应收申购款	2, 149. 74	-	-	-	-	25, 328. 27	27, 478. 01
应收证券清算款	-	-	-	-	-	37, 024, 528. 99	37, 024, 528. 99
其他资产	-	-	-	-	-	1, 381, 863. 57	1, 381, 863. 57
资产总计	15, 990, 612. 31	2, 002, 400. 00	82, 282, 400. 00	3, 509, 400. 00	18, 126, 148. 50	1, 870, 732. 217. 20	1, 992, 643, 178. 01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	13, 559, 673. 81	13, 559, 673. 81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1, 850, 381. 85	1, 850, 381. 85
应付托管费	-	-	-	-	-	252, 324. 8	252, 324. 85

						5	
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5.17	5.17
卖出回购金融资产款	70,112,589.43	-	-	-	-	-	70,112,589.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69,095.39	69,095.39
应交税费	-	-	-	-	-	8,407.78	8,407.78
其他负债	-	-	-	-	-	655,646.89	655,646.89
负债总计	70,112,589.43	-	-	-	-	16,395,535.74	86,508,125.17
利率敏感度缺口	-54,121,977.12	2,002,400.00	82,282,400.00	3,509,400.00	18,126,148.50	1,854,336,681.46	1,906,135,052.84

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动； 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	利率+1%	-449,059.79	-495,734.53
	利率-1%	455,849.44	501,742.91

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币元	折合人民币元	折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	19,063,765.49	-	19,063,765.49
资产合计	-	19,063,765.49	-	19,063,765.49
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	19,063,765.49	-	19,063,765.49
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	24,139,165.79	-	24,139,165.79
资产合计	-	24,139,165.79	-	24,139,165.79
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	24,139,165.79	-	24,139,165.79

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对人民币贬值 5%	-953,188.27	-1,206,958.29

	所有外币相对人民币升值 5%	953,188.27	1,206,958.29
--	----------------	------------	--------------

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例范围为本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,473,715,403.50	96.56	1,832,300,496.37	96.13
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	141,326,037.97	9.26	117,922,748.50	6.19
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,615,041,441.47	105.82	1,950,223,244.87	102.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM)
----	---

	描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10%时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩基准+10%	151,213,283.81	186,082,872.58
	业绩基准-10%	-151,213,283.81	-186,082,872.58

注：本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体重要性，被划分为三个层次：

- 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；
- 第三层次输入值是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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,384,945,149.36	1,741,580,076.87
第二层次	118,174,816.53	103,002,704.49
第三层次	111,921,475.58	105,640,463.51

合计	1,615,041,441.47	1,950,223,244.87
----	------------------	------------------

注：根据中国证监会 2022 年 5 月 26 日发布的证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》模板，本基金对上年度末公允价值层次进行追溯调整。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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 2022 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（2021 年 12 月 31 日：无）。

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货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	1,473,715,403.50	89.99
	其中：股票	1,473,715,403.50	89.99
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	141,326,037.97	8.63
	其中：债券	141,326,037.97	8.63
	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	14,500,000.00	0.89
	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	1,949,742.45	0.12

8	其他各项资产	6,179,491.61	0.38
9	合计	1,637,670,675.53	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 117,525,495.00 元，占基金资产净值比例 7.70%。本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 19063765.49 元，占基金资产净值比例 1.25%。

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	-	-
B	采矿业	49,220,774.76	3.22
C	制造业	530,103,070.10	34.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	28,296,322.00	1.85
F	批发和零售业	16,714,974.40	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	34,312,752.00	2.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,111,795.60	5.31
J	金融业	292,520,621.51	19.17
K	房地产业	35,409,248.36	2.32
L	租赁和商务服务业	58,209,207.00	3.81
M	科学研究和技术服务业	5,686,578.11	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	8,859,428.08	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,002,676.20	0.92
S	综合	-	-
	合计	1,154,447,448.12	75.64

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	14,369,308.68	0.94
B	采矿业	8,348,303.44	0.55

C	制造业	197,789,967.10	12.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,960,000.00	0.39
E	建筑业	16,119,045.04	1.06
F	批发和零售业	1,928,358.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,327,410.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,156,616.46	1.45
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	30,307.77	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	41,695.20	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	30,113,218.42	1.97
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	300,204,189.89	19.67

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	7,001,207.92	0.46
通信服务	12,062,557.57	0.79
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	19,063,765.49	1.25

注：以上分类采用全球行业分类标准（Global Industry Classification Standard, GICS）。

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	52,800	107,976,000.00	7.07
2	601601	中国太保	3,288,007	77,366,804.71	5.07
3	600741	华域汽车	3,112,867	71,595,941.00	4.69
4	601888	中国中免	249,900	58,209,207.00	3.81
5	601318	中国平安	911,200	42,543,928.00	2.79
6	600036	招商银行	1,007,913	42,533,928.60	2.79
7	000895	双汇发展	1,431,819	41,952,296.70	2.75
8	600195	中牧股份	3,380,880	41,449,588.80	2.72
9	600718	东软集团	3,391,978	39,041,666.78	2.56
10	601166	兴业银行	1,618,889	32,215,891.10	2.11
11	000001	平安银行	2,058,900	30,842,322.00	2.02
12	601009	南京银行	2,798,568	29,161,078.56	1.91
13	000858	五粮液	133,800	27,018,234.00	1.77
14	600161	天坛生物	985,400	23,925,512.00	1.57
15	000651	格力电器	699,300	23,580,396.00	1.54
16	600584	长电科技	868,884	23,459,868.00	1.54
17	000100	TCL 科技	4,698,000	22,503,420.00	1.47
18	601668	中国建筑	4,107,000	21,849,240.00	1.43
19	600028	中国石化	4,819,947	19,665,383.76	1.29
20	001979	招商蛇口	1,267,700	17,025,211.00	1.12
21	300383	光环新网	1,526,717	15,908,391.14	1.04
22	600352	浙江龙盛	1,453,500	14,796,630.00	0.97
23	601006	大秦铁路	2,118,800	13,962,892.00	0.91
24	000069	华侨城 A	2,138,664	13,879,929.36	0.91
25	002555	三七互娱	623,200	13,230,536.00	0.87
26	002415	海康威视	360,800	13,060,960.00	0.86
27	000157	中联重科	1,800,100	11,088,616.00	0.73
28	000568	泸州老窖	44,000	10,847,760.00	0.71
29	600153	建发股份	829,900	10,846,793.00	0.71
30	002422	科伦药业	576,689	10,784,084.30	0.71
31	600009	上海机场	189,800	10,761,660.00	0.71
32	601225	陕西煤业	500,000	10,590,000.00	0.69
33	002050	三花智控	358,000	9,837,840.00	0.64
34	601088	中国神华	290,000	9,657,000.00	0.63
35	601816	京沪高铁	1,910,000	9,588,200.00	0.63
36	002739	万达电影	661,588	9,030,676.20	0.59
37	601398	工商银行	1,880,000	8,967,600.00	0.59

38	603799	华友钴业	91,790	8,776,959.80	0.58
39	601997	贵阳银行	1,282,121	7,449,123.01	0.49
40	600299	安迪苏	767,400	7,351,692.00	0.48
41	002202	金风科技	469,600	6,950,080.00	0.46
42	300070	碧水源	1,333,848	6,949,348.08	0.46
43	600000	浦发银行	858,053	6,873,004.53	0.45
44	600487	亨通光电	449,275	6,532,458.50	0.43
45	600019	宝钢股份	1,000,000	6,020,000.00	0.39
46	600690	海尔智家	218,900	6,010,994.00	0.39
47	002572	索菲亚	218,500	6,008,750.00	0.39
48	000425	徐工机械	1,068,600	5,759,754.00	0.38
49	000333	美的集团	89,500	5,404,905.00	0.35
50	002624	完美世界	376,100	5,404,557.00	0.35
51	601658	邮储银行	988,900	5,330,171.00	0.35
52	603259	药明康德	47,789	4,969,578.11	0.33
53	600985	淮北矿业	330,000	4,804,800.00	0.31
54	601899	紫金矿业	482,700	4,503,591.00	0.30
55	000999	华润三九	97,700	4,396,500.00	0.29
56	688099	晶晨股份	40,500	4,090,500.00	0.27
57	601628	中国人寿	128,800	4,003,104.00	0.26
58	601098	中南传媒	350,000	3,304,000.00	0.22
59	601390	中国中铁	491,300	3,016,582.00	0.20
60	600438	通威股份	50,000	2,993,000.00	0.20
61	601939	建设银行	493,200	2,988,792.00	0.20
62	600062	华润双鹤	108,800	2,791,808.00	0.18
63	600655	豫园股份	274,100	2,587,504.00	0.17
64	600521	华海药业	108,800	2,469,760.00	0.16
65	601360	三六零	283,909	2,418,904.68	0.16
66	601186	中国铁建	300,000	2,370,000.00	0.16
67	601336	新华保险	68,800	2,214,672.00	0.15
68	600325	华发股份	287,000	2,172,590.00	0.14
69	601200	上海环境	188,000	1,910,080.00	0.13
70	300413	芒果超媒	50,000	1,668,000.00	0.11
71	600383	金地集团	117,500	1,579,200.00	0.10
72	002867	周大生	97,400	1,512,622.00	0.10
73	002508	老板电器	30,000	1,080,900.00	0.07
74	600170	上海建工	350,000	1,060,500.00	0.07
75	600446	金证股份	98,000	1,017,240.00	0.07
76	601607	上海医药	50,000	904,000.00	0.06
77	600297	广汇汽车	326,900	853,209.00	0.06
78	600859	王府井	30,580	794,468.40	0.05
79	000402	金融街	126,440	752,318.00	0.05

80	600276	恒瑞医药	20,000	741,800.00	0.05
81	600739	辽宁成大	50,000	729,000.00	0.05
82	300676	华大基因	10,000	717,000.00	0.05
83	002252	上海莱士	100,000	593,000.00	0.04
84	600585	海螺水泥	10,000	352,800.00	0.02
85	002705	新宝股份	16,000	351,840.00	0.02
86	600597	光明乳业	10,000	126,300.00	0.01
87	601128	常熟银行	2,000	15,280.00	0.00
88	601838	成都银行	900	14,922.00	0.00

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	002182	云海金属	1,658,000	41,582,640.00	2.72
2	002044	美年健康	5,368,689	29,903,597.73	1.96
3	002728	特一药业	1,831,501	27,087,899.79	1.77
4	002773	康弘药业	1,595,211	23,832,452.34	1.56
5	300353	东土科技	2,531,646	22,126,586.04	1.45
6	300123	亚光科技	3,279,400	20,332,280.00	1.33
7	300647	超频三	1,695,593	17,413,740.11	1.14
8	300292	吴通控股	4,638,667	16,467,267.85	1.08
9	300506	名家汇	2,380,952	16,119,045.04	1.06
10	300511	雪榕生物	2,277,228	14,369,308.68	0.94
11	002792	通宇通讯	1,036,392	12,498,887.52	0.82
12	00700	腾讯控股	39,800	12,062,557.57	0.79
13	603041	美思德	694,444	8,194,439.20	0.54
14	002730	电光科技	841,220	7,041,011.40	0.46
15	600395	盘江股份	800,000	7,016,000.00	0.46
16	01810	小米集团-W	600,200	7,001,207.92	0.46
17	300695	兆丰股份	129,414	6,655,762.02	0.44
18	600674	川投能源	500,000	5,960,000.00	0.39
19	300293	蓝英装备	430,664	4,478,905.60	0.29
20	300793	佳禾智能	218,000	3,490,180.00	0.23
21	600754	锦江酒店	52,900	3,327,410.00	0.22
22	002558	巨人网络	347,300	3,177,795.00	0.21
23	300674	宇信科技	135,747	2,072,856.69	0.14
24	600729	重庆百货	89,400	1,928,358.00	0.13
25	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.09
26	600997	开滦股份	100,000	762,000.00	0.05
27	000423	东阿阿胶	18,800	694,660.00	0.05
28	688279	峰昭科技	5,505	406,929.60	0.03
29	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02

30	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.02
31	002013	中航机电	15,800	195,130.00	0.01
32	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
33	688209	英集芯	6,822	188,150.76	0.01
34	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
35	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.01
36	301150	中一科技	856	77,786.63	0.01
37	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
38	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
39	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
40	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
41	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
42	301109	军信股份	1,837	29,649.18	0.00
43	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
44	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
45	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
46	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
47	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
48	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
49	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
50	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
51	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
52	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
53	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
54	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
55	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
56	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
57	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
58	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
59	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
60	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	300353	东土科技	20,000,003.40	1.05
2	300511	雪榕生物	13,800,001.68	0.72
3	300647	超频三	12,699,991.57	0.67
4	600900	长江电力	11,490,000.00	0.60

5	002730	电光科技	8,000,002.20	0.42
6	300695	兆丰股份	7,000,003.26	0.37
7	603041	美思德	6,999,995.52	0.37
8	300674	宇信科技	3,000,008.70	0.16
9	688220	翱捷科技	1,440,547.70	0.08
10	600938	中国海油	1,296,054.00	0.07
11	688223	晶科能源	1,065,000.00	0.06
12	688331	荣昌生物	763,920.00	0.04
13	688349	三一重能	747,235.00	0.04
14	301238	瑞泰新材	670,647.88	0.04
15	688120	华海清科	658,974.52	0.03
16	301200	大族数控	655,812.96	0.03
17	688234	天岳先进	559,577.61	0.03
18	688153	唯捷创芯	511,088.40	0.03
19	688047	龙芯中科	501,200.70	0.03
20	601009	南京银行	493,000.00	0.03

注：“买入金额”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。

7.4.2 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	600900	长江电力	44,162,762.70	2.32
2	300292	吴通控股	22,363,453.00	1.17
3	600161	天坛生物	15,364,032.99	0.81
4	600741	华域汽车	14,680,701.00	0.77
5	601601	中国太保	12,565,008.00	0.66
6	601318	中国平安	12,348,719.00	0.65
7	002773	康弘药业	12,040,384.00	0.63
8	600519	贵州茅台	10,908,081.00	0.57
9	601166	兴业银行	10,399,255.26	0.55
10	600584	长电科技	9,200,609.00	0.48
11	002739	万达电影	8,300,260.00	0.44
12	300439	美康生物	7,588,915.15	0.40
13	601668	中国建筑	7,508,512.00	0.39
14	600036	招商银行	7,418,486.46	0.39
15	000001	平安银行	6,889,834.00	0.36
16	002182	云海金属	6,659,120.00	0.35
17	002415	海康威视	5,835,237.00	0.31
18	600352	浙江龙盛	5,739,058.00	0.30
19	000858	五粮液	5,338,612.00	0.28
20	300793	佳禾智能	5,274,576.71	0.28

注：“卖出金额”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。

7.4.3 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	101,457,238.23
卖出股票收入（成交）总额	342,748,013.99

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	15,288,200.82	1.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	72,983,326.03	4.78
	其中：政策性金融债	72,983,326.03	4.78
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	53,054,511.12	3.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	141,326,037.97	9.26

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	220404	22 农发 04	300,000	29,976,986.30	1.96
2	132018	G 三峡 EB1	207,010	28,973,318.10	1.90
3	190407	19 农发 07	200,000	20,608,646.58	1.35
4	210212	21 国开 12	200,000	20,354,000.00	1.33
5	019664	21 国债 16	100,000	10,164,621.92	0.67

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：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，

参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

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

前十名证券发行主体中，不存在发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、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

本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库之外的股票。

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	66,174.75
2	应收清算款	5,968,595.42
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	109,523.15
6	其他应收款	35,198.29
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,179,491.61

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132018	G 三峡 EB1	28,973,318.10	1.90
2	113050	南银转债	9,531,322.09	0.62
3	113052	兴业转债	7,493,159.95	0.49

4	110045	海澜转债	3,274,910.96	0.21
5	110079	杭银转债	1,195,194.20	0.08
6	123107	温氏转债	636,771.12	0.04
7	113051	节能转债	77,857.32	0.01

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	600718	东软集团	4,537,242.00	0.30	转融通流通受限
2	600741	华域汽车	3,790,400.00	0.25	转融通流通受限
3	000895	双汇发展	2,074,440.00	0.14	转融通流通受限
4	600195	中牧股份	1,927,272.00	0.13	转融通流通受限

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	300353	东土科技	22,126,586.04	1.45	非公开发行流通受限
2	002182	云海金属	17,307,708.00	1.13	转融通流通受限
3	002044	美年健康	3,194,395.00	0.21	转融通流通受限
4	002773	康弘药业	2,093,094.00	0.14	转融通流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
兴全中证 800 六个月持有指数 A	40,119	35,654.02	105,479,137.26	7.37	1,324,924,608.34	92.63
兴全中证 800 六个月持有指数 C	9,253	17,054.34	820,129.50	0.52	156,983,709.14	99.48
合计	49,372	32,168.18	106,299,266.76	6.69	1,481,908,317.48	93.31

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全中证 800 六个月持有指数 A	3,767,468.68	0.2634
	兴全中证 800 六个月持有指数 C	2,510.70	0.0016
	合计	3,769,979.38	0.2374

注：“占基金总份额比例”对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴全中证 800 六个月持有指数 A	0
	兴全中证 800 六个月持有指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全中证 800 六个月持有指数 A	>100
	兴全中证 800 六个月持有指数 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全中证 800 六个月持有指数 A	兴全中证 800 六个月持有指数 C
----	--------------------	--------------------

基金合同生效日 (2021 年 2 月 9 日)	2,502,409,679.69	374,745,419.98
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	1,670,491,950.92	187,192,631.44
本报告期基金总申购份额	44,177,880.08	2,348,799.45
减:本报告期基金总赎回份额	284,266,085.40	31,737,592.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,430,403,745.60	157,803,838.64

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动。

2022 年 1 月 21 日起,董承非先生离任公司副总经理;2022 年 1 月 28 日起,谢治宇先生任职公司副总经理;2022 年 6 月 30 日起,秦杰先生任职公司副总经理,郑文惠女士离任公司副总经理。

(2) 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

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

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 (%)	
兴业证券	3	196,994,223.47	57.31	183,459.80	64.74	-
安信证券	2	28,572,881.58	8.31	20,921.20	7.38	-
东方证券	1	28,222,817.06	8.21	20,639.06	7.28	新增1
天风证券	1	23,768,427.75	6.92	15,004.65	5.30	-
中信建投证券	4	17,768,222.85	5.17	11,217.02	3.96	新增1
华创证券	1	15,812,373.91	4.60	11,563.05	4.08	新增1
国盛证券	1	12,699,163.40	3.69	8,016.98	2.83	-
中金公司	2	12,186,253.71	3.55	7,693.12	2.71	-
国金证券	2	7,626,422.91	2.22	4,814.74	1.70	新增1
摩根大通证券	2	50,693.29	0.01	31.99	0.01	-
申万宏源证券	2	5,305.11	0.00	2.29	0.00	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	新增1
太平洋证券	1	-	-	-	-	-

万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

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 (%)
兴业证券	11,108,532.60	17.72	475,500,000.00	21.34	-	-
安信证券	-	-	3,030,000.00	0.14	-	-
东方证券	4,182,553.50	6.67	229,300,000.00	10.29	-	-
天风证券	19,846,091.20	31.66	448,096,000.00	20.11	-	-
中信建投证券	1,891,358.46	3.02	277,087,000.00	12.43	-	-
华创证券	16,578,378.24	26.44	207,064,000.00	9.29	-	-
国盛证券	9,052,052.27	14.44	566,550,000.00	25.42	-	-
中金公司	31,200.00	0.05	3,120,000.00	0.14	-	-
国金证券	-	-	16,200,000.00	0.73	-	-
摩根大通证券	2,109.75	0.00	800,000.00	0.04	-	-
申万宏源证券	-	-	120,000.00	0.01	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	1,700,000.00	0.08	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
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	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则工作的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-05
2	关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-06
3	关于旗下部分基金投资东土科技(300353)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-18
4	关于兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金投资关联方证券的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-19
5	关于旗下部分基金投资电光科技(002730)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-20
6	关于副总经理离任的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-21
7	关于旗下部分基金投资兆丰股份(300695)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-26
8	关于我司旗下基金参与腾安基金销售赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-26
9	关于使用自有资金自购旗下偏股型公募基金壹亿元的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-27
10	关于公司副总经理任职的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-28
11	关于兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金暂停接受大额申购(含定投)、大额转换转入申请的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-01-28
12	关于旗下部分基金投资宇信科技(300674)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-02-09
13	关于增加德邦证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2022-03-15

14	关于旗下部分基金投资雪榕生物(300511)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网站	2022-03-22
15	关于增加财达证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网站	2022-04-11
16	关于增加上海长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网站	2022-04-20
17	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网站	2022-05-06
18	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资美思德(603041)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网站	2022-05-06
19	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网站	2022-05-27
20	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	上海证券报、规定互联网站	2022-06-17
21	关于公司副总经理变更的公告	上海证券报、规定互联网站	2022-06-30

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,故不涉及本项特有风险。							

注：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22号)等有关规定,兴证全球基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下管理的公开募集证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具相关会计准则。执行新会计准则后,本公司旗下公

开募集证券投资基金将按照新金融工具相关会计准则的规定进行会计计量。

2、本基金每份基金份额的最短持有期为 6 个月。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 6 个月（6 个月指 30 天乘以 6 的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（不含该日）前，基金份额持有人不能提出赎回申请；自其最短持有期到期日（含该日）起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 6 个月内无法赎回的风险。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

基金管理人客户服务电话：400-678-0099，021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日