

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金
2020 年年度报告
2020 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	113
8.1 期末基金资产组合情况	113
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	114
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	115
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	118
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	119

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	120
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	120
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	120
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	120
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	120
8.12 投资组合报告附注	120
§9 基金份额持有人信息	122
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	122
9.2 期末上市基金前十名持有人	122
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	123
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	123
§10 开放式基金份额变动	123
§11 重大事件揭示	123
11.1 基金份额持有人大会决议	123
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	124
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	124
11.4 基金投资策略的改变	124
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	124
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	124
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	124
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	124
11.9 其他重大事件	127
12 影响投资者决策的其他重要信息	130
§13 备查文件目录	130
13.1 备查文件目录	130
13.2 存放地点	131
13.3 查阅方式	131

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安创业板 50ETF
场内简称	创业板 50
基金主代码	159949
交易代码	159949
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2016 年 6 月 30 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,419,785,113.00 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	创业板 50 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	朱学华	李申

负责人	联系电话	021-38969999	021-60637102
	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	021-60637111
传真		021-68863414	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区金融大街25号	
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼	
邮政编码	200120	100033	
法定代表人	朱学华	田国立	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
---------------	--------	--------	--------

本期已实现收益	4,875,078,301.17	1,901,454,642.33	-1,969,588,349.23
本期利润	5,561,701,934.25	3,506,755,217.47	-2,893,136,515.51
加权平均基金份额本期利润	0.5309	0.2579	-0.2807
本期加权平均净值利润率	56.61%	47.67%	-52.74%
本期基金份额净值增长率	88.75%	51.18%	-37.52%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	1,650,767,855.70	-2,832,190,226.30	-11,823,040,912.74
期末可供分配基金份额利润	0.1961	-0.3395	-0.5631
期末基金资产净值	10,497,194,404.17	5,510,594,886.70	9,172,244,200.26
期末基金份额净值	1.2467	0.6605	0.4369
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	24.67%	-33.95%	-56.31%

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

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	20.72%	1.77%	20.51%	1.78%	0.21%	-0.01%
过去六个月	32.61%	2.02%	32.34%	2.03%	0.27%	-0.01%
过去一年	88.75%	2.08%	88.74%	2.09%	0.01%	-0.01%
过去三年	78.28%	1.94%	87.74%	1.94%	-9.46%	0.00%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	24.67%	1.73%	37.79%	1.73%	-13.12%	0.00%

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

较

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金

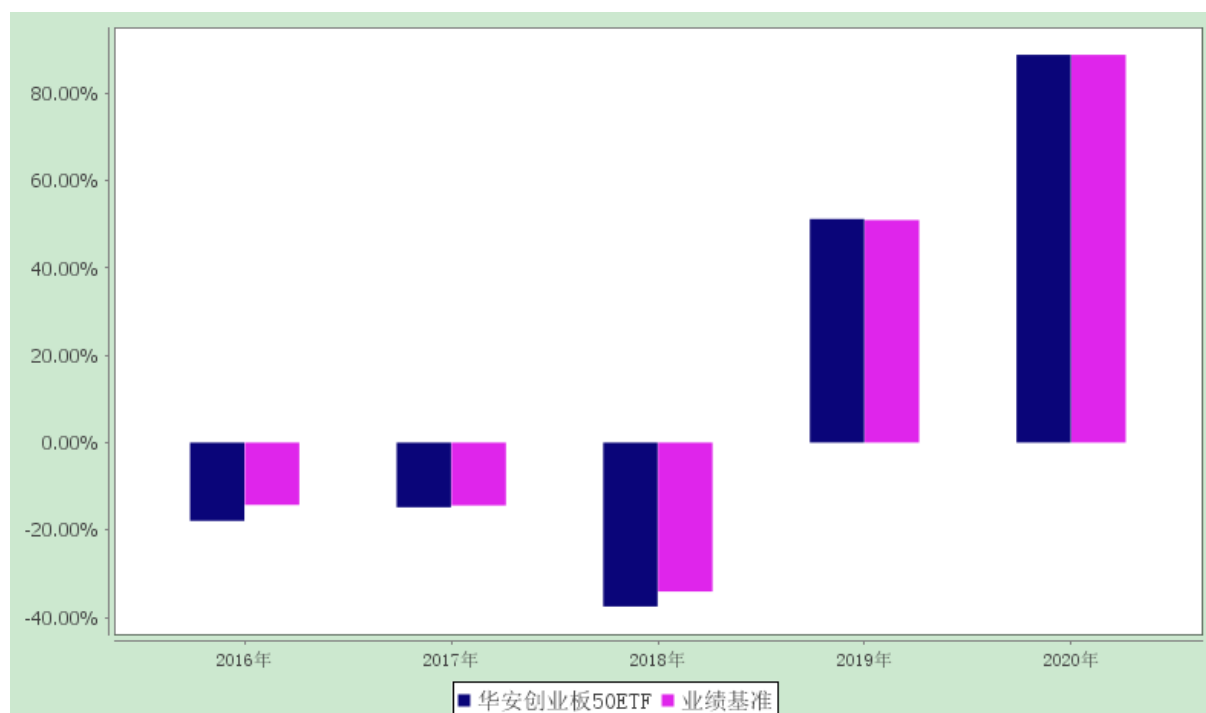
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016 年 6 月 30 日至 2020 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年没有利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、西安、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2020 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 149 只开放式基金，管理资产规模达到 4,701.62 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理，指数与量化投资部高级总监、总经理助理	2016-06-30	-	17 年	理学博士，17 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月至 2019 年 1 月，同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 1 月至 2019 年 3 月，同时担任华安量化多因子混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪

					深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 8 月起，同时担任华安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2020 年 11 月起，同时担任华安中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原

则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年受新冠疫情影响，全球经济遭遇困境，中国凭借强有力的防控措施率先复工复产，全年 GDP 增速 2.3%，成为 2020 年唯一实现正增长的主要经济体。从结构上看，投资和出口是拉动经济

增长的主要动力，而受疫情压制的消费对 GDP 造成了拖累。全球央行普遍采取宽松的货币政策和积极的财政政策应对疫情冲击。国内货币政策也较为温和，社融维持高速增长，基建、地产投资回升速度较快，工业生产已基本恢复至正常水平。

2020 年权益市场表现亮眼，各大股指均取得正收益，但收益分化较大。全年上证 50 上涨 18.85%，沪深 300 上涨 27.21%，创业板指上涨 64.96%，创业板 50 指数受益于新经济板块的业绩爆发上涨 88.74%，大幅跑赢市场。新能源车、光伏、半导体、医药等权重板块表现亮眼。上市公司营收层面，创业板和中小板企业表现较好，创业板 50 指数成分股前三季度净利润同比增长 53.8%，营业收入增长 31.2%，大幅超越主板上市公司的业绩。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.2467 元，本报告期份额净值增长率为 88.75%，同期业绩比较基准增长率为 88.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年将是全球经济的复苏年。对于国内经济而言，制造业回归、出口改善和消费复苏将是主要趋势，基建和房地产投资预期转弱，难以成为拉动经济的主要力量。在经济结构转型升级的背景之下，制造业投资有望实现高增长。货币政策方面，2021 年货币政策预计趋于稳健和中性，由宽松回归常态。

市场方面，2021 年的结构性机会大于系统性机会。与宏观经济紧密相关的金融和周期板块盈利能力有望提升，中长期看，科技成长依然是主线。“十四五规划”中明确提出要强化推进创新驱动发展，科技创新和产业链自主可控是长期战略方向。

新能源、生物医药、半导体、消费电子等新兴科技板块将在政策、资金、业绩的三重驱动下进入长期向上通道，创业板 50 代表的科技核心资产具有较高的配置价值。

作为基金管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

（1）继续深化“主动合规”的管理理念，积极开展形式多样的合规教育培训，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

（2）积极落实新《证券法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等法规要求，督促各项工作稳妥、有序开展。

（3）强化内控建设，推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险。

（4）构建贯穿公司各业务和产品条线的合规咨询服务体系，积极参与新产品、新业务评估工作，提供合规意见和建议，保障新产品、新业务合规开展。

（5）对公司内部重要规章制度、重大决策、产品和业务方案、重要法律文本、对外披露材料、宣传推介材料等进行合规性审查，严把合规质量关。

（6）定期组织开展内部审计、专项稽核、合规有效性评估，对公司前中后各业务环节开展自查自纠，及时排除风险隐患和漏洞，促进合规和内控管理水平的提升，保障公司稳健经营。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按

约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 24871 号

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人: :

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华安创业板 50ETF 基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华安创业板 50ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华安创业板 50ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华安创业板 50ETF 基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华安创业板 50ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华安创业板 50ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安创业板 50ETF 基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也

执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安创业板 50ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安创业板 50ETF 基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

许 康 玮 楼 茜 蓉

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	30,078,837.99	27,891,783.76
结算备付金		1,385,678.01	386,561.73
存出保证金		197,809.14	42,813.21
交易性金融资产	7.4.7.2	10,470,128,316.11	5,487,973,164.37
其中：股票投资		10,470,128,316.11	5,487,973,164.37
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,229,384.46	-
应收利息	7.4.7.5	1,267,913.66	131,645.53
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	112,121.73
资产总计		10,507,287,939.37	5,516,538,090.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		260,706.73	1,004,220.42
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		4,546,895.41	2,316,872.86
应付托管费		909,379.12	463,374.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,900,008.68	1,343,353.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,476,545.26	815,382.44
负债合计		10,093,535.20	5,943,203.63
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	8,419,785,113.00	8,342,785,113.00
未分配利润	7.4.7.10	2,077,409,291.17	-2,832,190,226.30
所有者权益合计		10,497,194,404.17	5,510,594,886.70
负债和所有者权益总计		10,507,287,939.37	5,516,538,090.33

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2467 元，基金份额总额 8,419,785,113.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		5,630,133,747.02	3,560,397,247.41
1.利息收入		19,491,459.94	1,824,914.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	298,102.28	437,485.65
债券利息收入		3,789.19	4,705.59
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		19,189,568.47	1,382,722.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,914,705,711.01	1,940,980,146.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,881,939,762.25	1,902,045,755.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	7,049,273.67	3,496,812.10
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	25,716,675.09	35,437,579.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	686,623,633.08	1,605,300,575.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	9,312,942.99	12,291,611.34
减：二、费用		68,431,812.77	53,642,029.94
1. 管理人报酬		48,526,148.05	36,847,678.08
2. 托管费		9,705,229.74	7,369,535.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	7,017,523.17	6,877,453.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		13.65	15.53
7. 其他费用	7.4.7.19	3,182,898.16	2,547,347.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,561,701,934.25	3,506,755,217.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,561,701,934.25	3,506,755,217.47

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,342,785,113.00	-2,832,190,226.30	5,510,594,886.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,561,701,934.25	5,561,701,934.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	77,000,000.00	-652,102,416.78	-575,102,416.78
其中：1.基金申购款	79,500,000,000.00	-4,711,663,184.65	74,788,336,815.35
2.基金赎回款	-79,423,000,000.00	4,059,560,767.87	-75,363,439,232.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	8,419,785,113.00	2,077,409,291.17	10,497,194,404.17
项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	20,995,285,113.00	-11,823,040,912.74	9,172,244,200.26

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,506,755,217.47	3,506,755,217.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-12,652,500,000.00	5,484,095,468.97	-7,168,404,531.03
其中：1.基金申购款	55,929,500,000.00	-25,218,182,761.19	30,711,317,238.81
2.基金赎回款	-68,582,000,000.00	30,702,278,230.16	-37,879,721,769.84
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	8,342,785,113.00	-2,832,190,226.30	5,510,594,886.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]867 号《关于准予华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 550,247,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 870 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2016 年 6 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 550,285,113.00 份基金份额，其中网上现金方式认购资金利息折合 38,113.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管

人为中国建设银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2016]461 号文审核同意, 本基金 550,285,113.00 份基金份额于 2016 年 7 月 22 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金的标的指数为创业板 50 指数, 投资目标是紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化; 投资范围为标的指数创业板 50 指数的成份股(含存托凭证) 及其备选成份股(含存托凭证)、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、固定收益资产(国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、中小企业私募债、债券回购、银行存款等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为: 投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%, 其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为: 创业板 50 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2021 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终

止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额，以及由本基金申购对价包含可以现金替代时被可以替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的

公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	30,078,837.99	27,891,783.76
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	30,078,837.99	27,891,783.76

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,111,282,783.09	10,470,128,316.11	1,358,845,533.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-

合计		9,111,282,783.09	10,470,128,316.11	1,358,845,533.02
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,815,751,264.43	5,487,973,164.37	672,221,899.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,815,751,264.43	5,487,973,164.37	672,221,899.94

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,204.44	5,026.22
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	621.87	294.82
应收债券利息	-	-

应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	1,263,998.35	126,305.19
其他	89.00	19.30
合计	1,267,913.66	131,645.53

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应收替代款	-	112,121.73
合计	-	112,121.73

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,900,008.68	1,343,353.32
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,900,008.68	1,343,353.32

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

应付证券出借违约金	-	-
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	155,000.00	143,000.00
应付替代款	67,410.39	-
指数使用费	858,076.47	426,154.64
可退替代款	276,058.40	126,227.80
合计	1,476,545.26	815,382.44

注：1. 应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,342,785,113.00	8,342,785,113.00
本期申购	79,500,000,000.00	79,500,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-79,423,000,000.00	-79,423,000,000.00
本期末	8,419,785,113.00	8,419,785,113.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,195,024,449.91	-637,165,776.39	-2,832,190,226.30
本期利润	4,875,078,301.17	686,623,633.08	5,561,701,934.25
本期基金份额交易产生的变动数	-1,029,285,995.56	377,183,578.78	-652,102,416.78
其中：基金申购款	-1,598,463,471.28	-3,113,199,713.37	-4,711,663,184.65
基金赎回款	569,177,475.72	3,490,383,292.15	4,059,560,767.87

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,650,767,855.70	426,641,435.47	2,077,409,291.17

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	216,424.19	235,139.29
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	79,579.21	197,918.71
其他	2,098.88	4,427.65
合计	298,102.28	437,485.65

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	92,683,006.93	-46,671,555.79
股票投资收益——赎回差价收入	4,789,256,755.32	1,948,717,311.52
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	4,881,939,762.25	1,902,045,755.73

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,130,759,321.36	2,026,103,955.79
减：卖出股票成本总额	2,038,076,314.43	2,072,775,511.58

买卖股票差价收入	92,683,006.93	-46,671,555.79
----------	---------------	----------------

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	75,363,439,232.13	37,879,721,769.84
减：现金支付赎回款总额	-248,852,751.87	-1,356,512,740.16
减：赎回股票成本总额	70,823,035,228.68	37,287,517,198.48
赎回差价收入	4,789,256,755.32	1,948,717,311.52

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,049,273.67	3,496,812.10
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	7,049,273.67	3,496,812.10

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	29,490,176.65	29,369,961.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,437,000.00	25,867,600.00
减：应收利息总额	3,902.98	5,549.43
买卖债券差价收入	7,049,273.67	3,496,812.10

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	25,716,675.09	35,437,579.05
其中：证券出借权益补偿收入	1,914,465.24	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	25,716,675.09	35,437,579.05

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	686,623,633.08	1,605,300,575.14
——股票投资	686,623,633.08	1,605,233,646.90
——债券投资	-	66,928.24
——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	686,623,633.08	1,605,300,575.14

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	9,312,942.99	12,291,611.34
合计	9,312,942.99	12,291,611.34

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	7,017,523.17	6,877,453.12
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	7,017,523.17	6,877,453.12

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	155,000.00	143,000.00
信息披露费	100,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	2,911,568.87	2,210,860.65
银行汇划费	16,129.29	13,126.89
其他费用	200.00	-

上市年费	-	60,000.00
账户维护费	-	360.00
合计	3,182,898.16	2,547,347.54

注：根据《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支。指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，收取下限为每季 5 万元。逐日累计，每季支付一次。计算方法如下：日指数许可使用费 = 前一日基金资产净值 × 0.03% / 当年天数。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据华安基金管理有限公司于 2021 年 3 月 9 日发布的公告，经华安基金管理有限公司股东会第六十六次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2021]669 号文核准，华安基金管理有限公司股东上海锦江国际投资管理有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 8% 的股权转让给国泰君安证券股份有限公司。

截至财务报表批准日，除上述事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	4,885,527,050.08	100.00%	4,105,520,174.88	84.65%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	51,927,176.65	100.00%	16,193,739.60	55.14%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	4,452,188.92	100.00%	2,900,008.68	100.00%
关联方名称	上年度可比期间			
	2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	3,741,367.13	84.65%	1,343,353.32	100.00%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	48,526,148.05	36,847,678.08
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日

当期发生的基金应支付的托管费	9,705,229.74	7,369,535.67
----------------	--------------	--------------

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币

本期 2020年1月1日至2020年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	2,154,948,688.40	4,000,513.14	349,480,850.00	385,422.62
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	309,317,200.00	234,312.20	83,635,800.00	52,388.36

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份

		总份额的比 例		额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	1,976,000.00	0.02%	-	-
中国建设银行股份 有限公司—华 安创业板 50 交易 型开放式指数证 券投资基金联接 基金	1,277,756,832.00	15.18%	356,984,332.00	4.28%

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	30,078,837.99	216,424.19	27,891,783.76	235,139.29

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国泰君安证 券股份有限 公司	003003	天元股份	网下申购	756.00	7,930.44
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额

国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-
----------------------	---	---	---	---	---

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新股限售	71.71	90.85	166.00	11,903.86	15,081.10	-
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	新股限售	41.26	43.28	593.00	24,467.18	25,665.04	-
300869	康泰医学	2020-08-12	2021-02-24	新股限售	10.16	110.88	862.00	8,757.92	95,578.56	-
300871	回盛生物	2020-08-13	2021-02-24	新股限售	33.61	38.70	618.00	20,770.98	23,916.60	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股限售	21.34	37.84	871.00	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新股限售	30.72	41.32	484.00	14,868.48	19,998.88	-
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	新股限售	30.54	50.85	569.00	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	新股限售	41.34	48.72	401.00	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	新股限售	10.58	27.12	466.00	4,930.28	12,637.92	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新股限售	14.17	32.31	291.00	4,123.47	9,402.21	-

300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	新股限售	24.87	33.51	499.00	12,410.13	16,721.49	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新股限售	44.47	74.52	210.00	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新股限售	27.97	30.12	479.00	13,397.63	14,427.48	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	新股限售	3.64	16.40	1,143.00	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-24	新股限售	26.66	60.01	272.00	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	新股限售	13.47	35.08	276.00	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-06-30	新股限售	14.07	36.97	628.00	8,835.96	23,217.16	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新股限售	12.65	45.30	283.00	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新股限售	118.27	603.36	473.00	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股限售	10.78	33.03	496.00	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020-10-19	2021-04-29	新股限售	17.87	33.16	879.00	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安达	2020-10-22	2021-04-29	新股限售	15.38	24.26	551.00	8,474.38	13,367.26	-
300907	康平科技	2020-11-11	2021-05-18	新股限售	14.30	26.85	473.00	6,763.90	12,700.05	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股限售	39.74	60.44	285.00	11,325.90	17,225.40	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	新股限售	30.26	47.87	474.00	14,343.24	22,690.38	-
300913	兆龙互连	2020-11-27	2021-06-07	新股限售	13.21	23.94	630.00	8,322.30	15,082.20	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	新股限售	4.97	8.94	1,063.00	5,283.11	9,503.22	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新股限售	16.05	31.58	287.00	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	新股限售	20.08	37.33	353.00	7,088.24	13,177.49	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480.00	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387.00	5,909.49	5,909.49	-

300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225.00	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	10.76	10.76	359.00	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股限售	13.39	13.39	217.00	2,905.63	2,905.63	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946.00	26,056.94	26,056.94	-

注：1、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
300182	捷成股份	2020-12-30	重大事项停牌	3.23	2021-01-07	3.40	9,301,700.00	47,641,171.20	30,044,491.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.3 期末参与转融通证券出借业务的证券

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：）	期末估值总额
------	------	------	------	-------	--------	---------	--------

202012 040000 4906	300058	蓝色光标	2020-12-04	2021-01-04	6.00	30,000.00	180,000.00
202012 040000 4908	300058	蓝色光标	2020-12-04	2021-01-04	6.00	30,000.00	180,000.00
202012 040000 4910	300207	欣旺达	2020-12-04	2021-01-04	30.71	10,000.00	307,100.00
202012 040000 4912	300251	光线传媒	2020-12-04	2021-01-04	12.07	20,000.00	241,400.00
202012 040000 4914	300059	东方财富	2020-12-04	2021-01-04	31.00	10,000.00	310,000.00
202012 040000 4916	300315	掌趣科技	2020-12-04	2021-01-04	5.11	30,000.00	153,300.00
202012 040000 4918	300748	金力永磁	2020-12-04	2021-01-04	36.34	10,000.00	363,400.00
202012 040000 4920	300748	金力永磁	2020-12-04	2021-01-04	36.34	10,000.00	363,400.00
202012 040000 4998	300207	欣旺达	2020-12-04	2021-01-04	30.71	10,000.00	307,100.00
202012 040000 5000	300207	欣旺达	2020-12-04	2021-01-04	30.71	27,000.00	829,170.00
202012 040000 5002	300253	卫宁健康	2020-12-04	2021-01-04	17.50	19,000.00	332,500.00
202012 040000 5004	300088	长信科技	2020-12-04	2021-01-04	8.89	90,000.00	800,100.00
202012 040000 5006	300024	机器人	2020-12-04	2021-01-04	12.30	43,000.00	528,900.00
202012 040000 5008	300251	光线传媒	2020-12-04	2021-01-04	12.07	40,000.00	482,800.00
202012 070000	300408	三环集团	2020-12-07	2021-01-04	37.25	29,000.00	1,080,250.00

0208							
202012 070000 0210	300182	捷成股份	2020-12-07	2021-01-07	3.23	194,000.00	626,620.00
202012 070000 0211	300146	汤臣倍健	2020-12-07	2021-01-04	24.15	39,000.00	941,850.00
202012 070000 0214	300003	乐普医疗	2020-12-07	2021-01-04	27.18	34,000.00	924,120.00
202012 070000 0216	300383	光环新网	2020-12-07	2021-01-04	17.17	52,000.00	892,840.00
202012 070000 0218	300676	华大基因	2020-12-07	2021-01-04	128.56	8,000.00	1,028,480.00
202012 070000 0220	300124	汇川技术	2020-12-07	2021-01-04	93.30	12,000.00	1,119,600.00
202012 070000 0221	300347	泰格医药	2020-12-07	2021-01-04	161.61	8,000.00	1,292,880.00
202012 070000 0224	300142	沃森生物	2020-12-07	2021-01-04	38.56	10,000.00	385,600.00
202012 070000 0226	300207	欣旺达	2020-12-07	2021-01-04	30.71	37,000.00	1,136,270.00
202012 070000 0228	300059	东方财富	2020-12-07	2021-01-04	31.00	35,000.00	1,085,000.00
202012 070000 4570	300182	捷成股份	2020-12-07	2021-01-07	3.23	100,000.00	323,000.00
202012 070000 4572	300676	华大基因	2020-12-07	2021-01-04	128.56	13,000.00	1,671,280.00
202012 070000 4574	300088	长信科技	2020-12-07	2021-01-04	8.89	216,000.00	1,920,240.00
202012 070000 4576	300433	蓝思科技	2020-12-07	2021-01-04	30.61	100,000.00	3,061,000.00
202012	300033	同花顺	2020-12-07	2021-01-	123.98	20,000.00	2,479,600.00

070000 4578				04			0
202012 070000 4580	300274	阳光电源	2020-12-07	2021-01-04	72.28	200,000.00	14,456,000.00
202012 070000 4582	300760	迈瑞医疗	2020-12-07	2021-01-04	426.00	5,000.00	2,130,000.00
202012 070000 4584	300251	光线传媒	2020-12-07	2021-01-04	12.07	27,000.00	325,890.00
202012 070000 4586	300223	北京君正	2020-12-07	2021-01-04	91.49	25,000.00	2,287,250.00
202012 070000 4588	300316	晶盛机电	2020-12-07	2021-01-04	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 070000 4590	300413	芒果超媒	2020-12-07	2021-01-04	72.50	25,000.00	1,812,500.00
202012 070000 4592	300059	东方财富	2020-12-07	2021-01-04	31.00	79,000.00	2,449,000.00
202012 070000 4594	300017	网宿科技	2020-12-07	2021-01-04	6.89	247,000.00	1,701,830.00
202012 070000 4596	300124	汇川技术	2020-12-07	2021-01-04	93.30	32,000.00	2,985,600.00
202012 070000 4598	300113	顺网科技	2020-12-07	2021-01-04	17.15	110,000.00	1,886,500.00
202012 070000 4600	300146	汤臣倍健	2020-12-07	2021-01-04	24.15	92,000.00	2,221,800.00
202012 070000 4602	300450	先导智能	2020-12-07	2021-01-04	83.99	38,000.00	3,191,620.00
202012 070000 4910	300073	当升科技	2020-12-07	2021-01-04	64.85	10,000.00	648,500.00
202012 070000 4912	300253	卫宁健康	2020-12-07	2021-01-04	17.50	10,000.00	175,000.00

202012 070000 4914	300274	阳光电源	2020-12-07	2021-01-04	72.28	10,000.00	722,800.00
202012 070000 4916	300433	蓝思科技	2020-12-07	2021-01-04	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 070000 4918	300748	金力永磁	2020-12-07	2021-01-04	36.34	1,000.00	36,340.00
202012 070000 5058	300124	汇川技术	2020-12-07	2021-01-04	93.30	20,000.00	1,866,000.00
202012 070000 5060	300122	智飞生物	2020-12-07	2021-01-04	147.91	1,000.00	147,910.00
202012 070000 5062	300115	长盈精密	2020-12-07	2021-01-04	24.65	10,000.00	246,500.00
202012 070000 5064	300058	蓝色光标	2020-12-07	2021-01-04	6.00	110,000.00	660,000.00
202012 070000 5066	300058	蓝色光标	2020-12-07	2021-01-04	6.00	40,000.00	240,000.00
202012 080000 0261	300073	当升科技	2020-12-08	2021-01-05	64.85	7,000.00	453,950.00
202012 080000 0263	300782	卓胜微	2020-12-08	2021-01-05	570.54	7,000.00	3,993,780.00
202012 080000 0264	300142	沃森生物	2020-12-08	2021-01-05	38.56	63,000.00	2,429,280.00
202012 080000 0267	300748	金力永磁	2020-12-08	2021-01-05	36.34	1,000.00	36,340.00
202012 080000 0269	300223	北京君正	2020-12-08	2021-01-05	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 080000 0271	300142	沃森生物	2020-12-08	2021-01-05	38.56	92,000.00	3,547,520.00
202012 080000	300253	卫宁健康	2020-12-08	2021-01-05	17.50	72,000.00	1,260,000.00

0273							
202012 080000 0275	300315	掌趣科技	2020-12-08	2021-01-05	5.11	116,000.00	592,760.00
202012 080000 0277	300251	光线传媒	2020-12-08	2021-01-05	12.07	43,000.00	519,010.00
202012 080000 0279	300166	东方国信	2020-12-08	2021-01-05	10.95	22,000.00	240,900.00
202012 080000 0281	300070	碧水源	2020-12-08	2021-01-05	7.65	69,000.00	527,850.00
202012 080000 0283	300182	捷成股份	2020-12-08	2021-01-07	3.23	10,000.00	32,300.00
202012 080000 0285	300251	光线传媒	2020-12-08	2021-01-05	12.07	10,000.00	120,700.00
202012 080000 0287	300058	蓝色光标	2020-12-08	2021-01-05	6.00	322,000.00	1,932,000.00
202012 080000 0289	300122	智飞生物	2020-12-08	2021-01-05	147.91	23,000.00	3,401,930.00
202012 080000 0291	300142	沃森生物	2020-12-08	2021-01-05	38.56	150,000.00	5,784,000.00
202012 080000 0293	300017	网宿科技	2020-12-08	2021-01-05	6.89	139,000.00	957,710.00
202012 080000 0295	300383	光环新网	2020-12-08	2021-01-05	17.17	35,000.00	600,950.00
202012 080000 0297	300760	迈瑞医疗	2020-12-08	2021-01-05	426.00	2,000.00	852,000.00
202012 080000 0299	300088	长信科技	2020-12-08	2021-01-05	8.89	150,000.00	1,333,500.00
202012 080000 0301	300383	光环新网	2020-12-08	2021-01-05	17.17	19,000.00	326,230.00
202012	300142	沃森生物	2020-12-08	2021-01-	38.56	156,000.00	6,015,360.00

080000 0303				05			0
202012 080000 0305	300223	北京君正	2020-12-08	2021-01-05	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 080000 4554	300433	蓝思科技	2020-12-08	2021-01-05	30.61	42,000.00	1,285,620.00
202012 080000 4556	300251	光线传媒	2020-12-08	2021-01-05	12.07	1,000.00	12,070.00
202012 080000 4558	300748	金力永磁	2020-12-08	2021-01-05	36.34	1,000.00	36,340.00
202012 080000 4560	300666	江丰电子	2020-12-08	2021-01-05	49.51	1,000.00	49,510.00
202012 080000 4562	300618	寒锐钴业	2020-12-08	2021-01-05	94.91	10,000.00	949,100.00
202012 080000 4564	300433	蓝思科技	2020-12-08	2021-01-05	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 080000 4566	300274	阳光电源	2020-12-08	2021-01-05	72.28	10,000.00	722,800.00
202012 080000 4568	300223	北京君正	2020-12-08	2021-01-05	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 080000 4604	300122	智飞生物	2020-12-08	2021-01-05	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 080000 4606	300251	光线传媒	2020-12-08	2021-01-05	12.07	100,000.00	1,207,000.00
202012 080000 4608	300418	昆仑万维	2020-12-08	2021-01-05	19.95	12,000.00	239,400.00
202012 080000 4610	300316	晶盛机电	2020-12-08	2021-01-05	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 080000 4612	300182	捷成股份	2020-12-08	2021-01-07	3.23	50,000.00	161,500.00

202012 080000 4614	300073	当升科技	2020-12-08	2021-01-05	64.85	50,000.00	3,242,500.00
202012 080000 4616	300760	迈瑞医疗	2020-12-08	2021-01-05	426.00	10,000.00	4,260,000.00
202012 080000 4618	300207	欣旺达	2020-12-08	2021-01-05	30.71	10,000.00	307,100.00
202012 080000 4620	300253	卫宁健康	2020-12-08	2021-01-05	17.50	10,000.00	175,000.00
202012 080000 4622	300136	信维通信	2020-12-08	2021-01-05	35.88	38,000.00	1,363,440.00
202012 080000 4732	300033	同花顺	2020-12-08	2021-01-05	123.98	1,000.00	123,980.00
202012 080000 4734	300059	东方财富	2020-12-08	2021-01-05	31.00	21,000.00	651,000.00
202012 080000 4736	300073	当升科技	2020-12-08	2021-01-05	64.85	7,000.00	453,950.00
202012 080000 4738	300073	当升科技	2020-12-08	2021-01-05	64.85	1,000.00	64,850.00
202012 080000 4740	300033	同花顺	2020-12-08	2021-01-05	123.98	1,000.00	123,980.00
202012 080000 4742	300014	亿纬锂能	2020-12-08	2021-01-05	81.50	1,000.00	81,500.00
202012 080000 4760	300115	长盈精密	2020-12-08	2021-01-05	24.65	10,000.00	246,500.00
202012 080000 4762	300122	智飞生物	2020-12-08	2021-01-05	147.91	3,000.00	443,730.00
202012 080000 4764	300601	康泰生物	2020-12-08	2021-01-05	174.50	3,000.00	523,500.00
202012 080000	300113	顺网科技	2020-12-08	2021-01-05	17.15	20,000.00	343,000.00

4766							
202012 080000 4768	300207	欣旺达	2020-12-08	2021-01-05	30.71	30,000.00	921,300.00
202012 080000 4770	300017	网宿科技	2020-12-08	2021-01-05	6.89	60,000.00	413,400.00
202012 080000 4772	300014	亿纬锂能	2020-12-08	2021-01-05	81.50	150,000.00	12,225,000.00
202012 080000 4774	300315	掌趣科技	2020-12-08	2021-01-05	5.11	75,000.00	383,250.00
202012 080000 4776	300073	当升科技	2020-12-08	2021-01-05	64.85	30,000.00	1,945,500.00
202012 080000 4778	300253	卫宁健康	2020-12-08	2021-01-05	17.50	10,000.00	175,000.00
202012 080000 4780	300122	智飞生物	2020-12-08	2021-01-05	147.91	26,000.00	3,845,660.00
202012 080000 4782	300058	蓝色光标	2020-12-08	2021-01-05	6.00	10,000.00	60,000.00
202012 080000 4784	300142	沃森生物	2020-12-08	2021-01-05	38.56	5,000.00	192,800.00
202012 080000 4786	300567	精测电子	2020-12-08	2021-01-05	54.94	19,000.00	1,043,860.00
202012 080000 4788	300115	长盈精密	2020-12-08	2021-01-05	24.65	41,000.00	1,010,650.00
202012 080000 4790	300207	欣旺达	2020-12-08	2021-01-05	30.71	80,000.00	2,456,800.00
202012 080000 4792	300316	晶盛机电	2020-12-08	2021-01-05	30.08	34,000.00	1,022,720.00
202012 090000 0521	300024	机器人	2020-12-09	2021-01-06	12.30	38,000.00	467,400.00
202012	300251	光线传媒	2020-12-09	2021-01-	12.07	12,000.00	144,840.00

090000 0523				06			
202012 090000 0525	300253	卫宁健康	2020-12-09	2021-01-06	17.50	38,000.00	665,000.00
202012 090000 0527	300070	碧水源	2020-12-09	2021-01-06	7.65	10,000.00	76,500.00
202012 090000 0528	300315	掌趣科技	2020-12-09	2021-01-06	5.11	117,000.00	597,870.00
202012 090000 0531	300166	东方国信	2020-12-09	2021-01-06	10.95	24,000.00	262,800.00
202012 090000 0543	300166	东方国信	2020-12-09	2021-01-06	10.95	10,000.00	109,500.00
202012 090000 0545	300251	光线传媒	2020-12-09	2021-01-06	12.07	34,000.00	410,380.00
202012 090000 0547	300122	智飞生物	2020-12-09	2021-01-06	147.91	30,000.00	4,437,300.00
202012 090000 0549	300024	机器人	2020-12-09	2021-01-06	12.30	50,000.00	615,000.00
202012 090000 0551	300408	三环集团	2020-12-09	2021-01-06	37.25	13,000.00	484,250.00
202012 090000 0553	300017	网宿科技	2020-12-09	2021-01-06	6.89	52,000.00	358,280.00
202012 090000 3598	300033	同花顺	2020-12-09	2021-01-06	123.98	13,000.00	1,611,740.00
202012 090000 3600	300122	智飞生物	2020-12-09	2021-01-06	147.91	4,000.00	591,640.00
202012 090000 3602	300070	碧水源	2020-12-09	2021-01-06	7.65	28,000.00	214,200.00
202012 090000 3604	300666	江丰电子	2020-12-09	2021-01-06	49.51	10,000.00	495,100.00

202012 090000 3606	300418	昆仑万维	2020-12-09	2021-01-06	19.95	76,000.00	1,516,200.00
202012 090000 3608	300033	同花顺	2020-12-09	2021-01-06	123.98	10,000.00	1,239,800.00
202012 090000 3610	300058	蓝色光标	2020-12-09	2021-01-06	6.00	10,000.00	60,000.00
202012 090000 3612	300070	碧水源	2020-12-09	2021-01-06	7.65	14,000.00	107,100.00
202012 090000 3614	300073	当升科技	2020-12-09	2021-01-06	64.85	20,000.00	1,297,000.00
202012 090000 3616	300122	智飞生物	2020-12-09	2021-01-06	147.91	50,000.00	7,395,500.00
202012 090000 3618	300661	圣邦股份	2020-12-09	2021-01-06	263.80	10,000.00	2,638,000.00
202012 090000 3620	300033	同花顺	2020-12-09	2021-01-06	123.98	10,000.00	1,239,800.00
202012 090000 3622	300253	卫宁健康	2020-12-09	2021-01-06	17.50	57,000.00	997,500.00
202012 090000 3624	300207	欣旺达	2020-12-09	2021-01-06	30.71	20,000.00	614,200.00
202012 090000 3626	300251	光线传媒	2020-12-09	2021-01-06	12.07	100,000.00	1,207,000.00
202012 090000 3628	300058	蓝色光标	2020-12-09	2021-01-06	6.00	254,000.00	1,524,000.00
202012 090000 3630	300496	中科创达	2020-12-09	2021-01-06	117.00	10,000.00	1,170,000.00
202012 090000 3632	300207	欣旺达	2020-12-09	2021-01-06	30.71	42,000.00	1,289,820.00
202012 090000	300315	掌趣科技	2020-12-09	2021-01-06	5.11	10,000.00	51,100.00

3634							
202012 090000 3636	300024	机器人	2020-12-09	2021-01-06	12.30	50,000.00	615,000.00
202012 090000 3638	300115	长盈精密	2020-12-09	2021-01-06	24.65	20,000.00	493,000.00
202012 090000 3640	300433	蓝思科技	2020-12-09	2021-01-06	30.61	110,000.00	3,367,100.00
202012 090000 3642	300253	卫宁健康	2020-12-09	2021-01-06	17.50	74,000.00	1,295,000.00
202012 090000 3644	300070	碧水源	2020-12-09	2021-01-06	7.65	69,000.00	527,850.00
202012 090000 3646	300274	阳光电源	2020-12-09	2021-01-06	72.28	30,000.00	2,168,400.00
202012 090000 3648	300024	机器人	2020-12-09	2021-01-06	12.30	38,000.00	467,400.00
202012 090000 3656	300024	机器人	2020-12-09	2021-01-06	12.30	10,000.00	123,000.00
202012 090000 3658	300274	阳光电源	2020-12-09	2021-01-06	72.28	53,000.00	3,830,840.00
202012 090000 3660	300073	当升科技	2020-12-09	2021-01-06	64.85	20,000.00	1,297,000.00
202012 090000 3662	300059	东方财富	2020-12-09	2021-01-06	31.00	150,000.00	4,650,000.00
202012 090000 3668	300316	晶盛机电	2020-12-09	2021-01-06	30.08	40,000.00	1,203,200.00
202012 100000 3264	300253	卫宁健康	2020-12-10	2021-01-07	17.50	57,000.00	997,500.00
202012 100000 3266	300070	碧水源	2020-12-10	2021-01-07	7.65	69,000.00	527,850.00
202012	300024	机器人	2020-12-10	2021-01-	12.30	38,000.00	467,400.00

100000 3268				07			
202012 100000 3270	300450	先导智能	2020-12-10	2021-01-07	83.99	10,000.00	839,900.00
202012 100000 3272	300251	光线传媒	2020-12-10	2021-01-07	12.07	50,000.00	603,500.00
202012 100000 3274	300182	捷成股份	2020-12-10	2021-01-07	3.23	20,000.00	64,600.00
202012 100000 3276	300253	卫宁健康	2020-12-10	2021-01-07	17.50	20,000.00	350,000.00
202012 100000 3278	300274	阳光电源	2020-12-10	2021-01-07	72.28	50,000.00	3,614,000.00
202012 100000 3280	300207	欣旺达	2020-12-10	2021-01-07	30.71	20,000.00	614,200.00
202012 100000 3282	300088	长信科技	2020-12-10	2021-01-07	8.89	30,000.00	266,700.00
202012 100000 3284	300315	掌趣科技	2020-12-10	2021-01-07	5.11	100,000.00	511,000.00
202012 100000 3286	300274	阳光电源	2020-12-10	2021-01-07	72.28	20,000.00	1,445,600.00
202012 100000 3288	300070	碧水源	2020-12-10	2021-01-07	7.65	80,000.00	612,000.00
202012 100000 3290	300750	宁德时代	2020-12-10	2021-01-07	351.11	10,000.00	3,511,100.00
202012 100000 3292	300251	光线传媒	2020-12-10	2021-01-07	12.07	30,000.00	362,100.00
202012 100000 3326	300253	卫宁健康	2020-12-10	2021-01-07	17.50	2,000.00	35,000.00
202012 100000 3328	300666	江丰电子	2020-12-10	2021-01-07	49.51	11,000.00	544,610.00

202012 100000 3330	300383	光环新网	2020-12-10	2021-01-07	17.17	40,000.00	686,800.00
202012 100000 3332	300124	汇川技术	2020-12-10	2021-01-07	93.30	10,000.00	933,000.00
202012 100000 3334	300142	沃森生物	2020-12-10	2021-01-07	38.56	300,000.00	11,568,000.00
202012 100000 3336	300251	光线传媒	2020-12-10	2021-01-07	12.07	30,000.00	362,100.00
202012 100000 3338	300058	蓝色光标	2020-12-10	2021-01-07	6.00	10,000.00	60,000.00
202012 100000 3340	300070	碧水源	2020-12-10	2021-01-07	7.65	18,000.00	137,700.00
202012 100000 3342	300315	掌趣科技	2020-12-10	2021-01-07	5.11	10,000.00	51,100.00
202012 100000 3344	300017	网宿科技	2020-12-10	2021-01-07	6.89	10,000.00	68,900.00
202012 100000 3346	300088	长信科技	2020-12-10	2021-01-07	8.89	15,000.00	133,350.00
202012 100000 3348	300115	长盈精密	2020-12-10	2021-01-07	24.65	10,000.00	246,500.00
202012 100000 3350	300115	长盈精密	2020-12-10	2021-01-07	24.65	4,000.00	98,600.00
202012 100000 3352	300251	光线传媒	2020-12-10	2021-01-07	12.07	10,000.00	120,700.00
202012 100000 3354	300251	光线传媒	2020-12-10	2021-01-07	12.07	14,000.00	168,980.00
202012 100000 3356	300122	智飞生物	2020-12-10	2021-01-07	147.91	22,000.00	3,254,020.00
202012 100000	300058	蓝色光标	2020-12-10	2021-01-07	6.00	10,000.00	60,000.00

3358							
202012 100000 3360	300251	光线传媒	2020-12-10	2021-01-07	12.07	20,000.00	241,400.00
202012 100000 3362	300450	先导智能	2020-12-10	2021-01-07	83.99	20,000.00	1,679,800.00
202012 100000 3364	300433	蓝思科技	2020-12-10	2021-01-07	30.61	1,000.00	30,610.00
202012 100000 3366	300003	乐普医疗	2020-12-10	2021-01-07	27.18	40,000.00	1,087,200.00
202012 100000 3368	300070	碧水源	2020-12-10	2021-01-07	7.65	18,000.00	137,700.00
202012 100000 3370	300073	当升科技	2020-12-10	2021-01-07	64.85	10,000.00	648,500.00
202012 100000 3372	300088	长信科技	2020-12-10	2021-01-07	8.89	50,000.00	444,500.00
202012 100000 3374	300017	网宿科技	2020-12-10	2021-01-07	6.89	150,000.00	1,033,500.00
202012 100000 3376	300058	蓝色光标	2020-12-10	2021-01-07	6.00	50,000.00	300,000.00
202012 100000 3378	300059	东方财富	2020-12-10	2021-01-07	31.00	100,000.00	3,100,000.00
202012 100000 3660	300017	网宿科技	2020-12-10	2021-01-07	6.89	52,000.00	358,280.00
202012 100000 3978	300166	东方国信	2020-12-10	2021-01-07	10.95	33,000.00	361,350.00
202012 100000 3980	300024	机器人	2020-12-10	2021-01-07	12.30	50,000.00	615,000.00
202012 100000 3982	300251	光线传媒	2020-12-10	2021-01-07	12.07	34,000.00	410,380.00
202012	300408	三环集团	2020-12-10	2021-01-	37.25	13,000.00	484,250.00

100000 3984				07			
202012 110000 2033	300182	捷成股份	2020-12-11	2021-01-08	3.23	20,000.00	64,600.00
202012 110000 2221	300433	蓝思科技	2020-12-11	2021-01-08	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 110000 2223	300251	光线传媒	2020-12-11	2021-01-08	12.07	56,000.00	675,920.00
202012 110000 2225	300113	顺网科技	2020-12-11	2021-01-08	17.15	10,000.00	171,500.00
202012 110000 2227	300418	昆仑万维	2020-12-11	2021-01-08	19.95	28,000.00	558,600.00
202012 110000 2229	300070	碧水源	2020-12-11	2021-01-08	7.65	81,000.00	619,650.00
202012 110000 2235	300253	卫宁健康	2020-12-11	2021-01-08	17.50	17,000.00	297,500.00
202012 110000 2237	300003	乐普医疗	2020-12-11	2021-01-08	27.18	18,000.00	489,240.00
202012 110000 2239	300618	寒锐钴业	2020-12-11	2021-01-08	94.91	10,000.00	949,100.00
202012 110000 2241	300166	东方国信	2020-12-11	2021-01-08	10.95	25,000.00	273,750.00
202012 110000 2243	300088	长信科技	2020-12-11	2021-01-08	8.89	20,000.00	177,800.00
202012 110000 2245	300166	东方国信	2020-12-11	2021-01-08	10.95	15,000.00	164,250.00
202012 110000 2247	300618	寒锐钴业	2020-12-11	2021-01-08	94.91	10,000.00	949,100.00
202012 110000 2249	300070	碧水源	2020-12-11	2021-01-08	7.65	53,000.00	405,450.00

202012 110000 2251	300146	汤臣倍健	2020-12-11	2021-01-08	24.15	11,000.00	265,650.00
202012 110000 2253	300496	中科创达	2020-12-11	2021-01-08	117.00	30,000.00	3,510,000.00
202012 110000 2255	300253	卫宁健康	2020-12-11	2021-01-08	17.50	60,000.00	1,050,000.00
202012 110000 2257	300003	乐普医疗	2020-12-11	2021-01-08	27.18	20,000.00	543,600.00
202012 110000 2259	300253	卫宁健康	2020-12-11	2021-01-08	17.50	40,000.00	700,000.00
202012 110000 2261	300136	信维通信	2020-12-11	2021-01-08	35.88	20,000.00	717,600.00
202012 110000 2263	300136	信维通信	2020-12-11	2021-01-08	35.88	30,000.00	1,076,400.00
202012 110000 2265	300383	光环新网	2020-12-11	2021-01-08	17.17	30,000.00	515,100.00
202012 110000 2267	300059	东方财富	2020-12-11	2021-01-08	31.00	40,000.00	1,240,000.00
202012 110000 2269	300760	迈瑞医疗	2020-12-11	2021-01-08	426.00	30,000.00	12,780,000.00
202012 110000 2279	300014	亿纬锂能	2020-12-11	2021-01-08	81.50	200,000.00	16,300,000.00
202012 110000 2281	300058	蓝色光标	2020-12-11	2021-01-08	6.00	100,000.00	600,000.00
202012 110000 2283	300567	精测电子	2020-12-11	2021-01-08	54.94	10,000.00	549,400.00
202012 110000 2285	300315	掌趣科技	2020-12-11	2021-01-08	5.11	100,000.00	511,000.00
202012 110000	300418	昆仑万维	2020-12-11	2021-01-08	19.95	20,000.00	399,000.00

2413							
202012 110000 2415	300433	蓝思科技	2020-12-11	2021-01-08	30.61	20,000.00	612,200.00
202012 110000 2417	300274	阳光电源	2020-12-11	2021-01-08	72.28	20,000.00	1,445,600.00
202012 110000 2419	300073	当升科技	2020-12-11	2021-01-08	64.85	20,000.00	1,297,000.00
202012 110000 2421	300251	光线传媒	2020-12-11	2021-01-08	12.07	50,000.00	603,500.00
202012 110000 2423	300088	长信科技	2020-12-11	2021-01-08	8.89	30,000.00	266,700.00
202012 110000 2425	300251	光线传媒	2020-12-11	2021-01-08	12.07	50,000.00	603,500.00
202012 110000 2427	300253	卫宁健康	2020-12-11	2021-01-08	17.50	10,000.00	175,000.00
202012 110000 2429	300433	蓝思科技	2020-12-11	2021-01-08	30.61	100,000.00	3,061,000.00
202012 110000 2431	300274	阳光电源	2020-12-11	2021-01-08	72.28	50,000.00	3,614,000.00
202012 140000 0666	300418	昆仑万维	2020-12-14	2021-01-11	19.95	50,000.00	997,500.00
202012 140000 0668	300059	东方财富	2020-12-14	2021-01-11	31.00	102,000.00	3,162,000.00
202012 140000 0669	300750	宁德时代	2020-12-14	2021-01-11	351.11	80,000.00	28,088,800.00
202012 140000 0672	300433	蓝思科技	2020-12-14	2021-01-11	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 140000 0673	300383	光环新网	2020-12-14	2021-01-11	17.17	10,000.00	171,700.00
202012	300315	掌趣科技	2020-12-14	2021-01-	5.11	57,000.00	291,270.00

140000 7717				11			
202012 140000 7719	300017	网宿科技	2020-12-14	2021-01-11	6.89	10,000.00	68,900.00
202012 140000 7721	300316	晶盛机电	2020-12-14	2021-01-11	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 140000 7723	300142	沃森生物	2020-12-14	2021-01-11	38.56	23,000.00	886,880.00
202012 140000 7725	300059	东方财富	2020-12-14	2021-01-11	31.00	185,000.00	5,735,000.00
202012 140000 7727	300017	网宿科技	2020-12-14	2021-01-11	6.89	50,000.00	344,500.00
202012 140000 7729	300601	康泰生物	2020-12-14	2021-01-11	174.50	10,000.00	1,745,000.00
202012 140000 7731	300253	卫宁健康	2020-12-14	2021-01-11	17.50	50,000.00	875,000.00
202012 140000 7733	300567	精测电子	2020-12-14	2021-01-11	54.94	10,000.00	549,400.00
202012 140000 7735	300142	沃森生物	2020-12-14	2021-01-11	38.56	32,000.00	1,233,920.00
202012 140000 7737	300315	掌趣科技	2020-12-14	2021-01-11	5.11	75,000.00	383,250.00
202012 140000 7739	300207	欣旺达	2020-12-14	2021-01-11	30.71	30,000.00	921,300.00
202012 140000 7843	300033	同花顺	2020-12-14	2021-01-11	123.98	10,000.00	1,239,800.00
202012 140000 7845	300058	蓝色光标	2020-12-14	2021-01-11	6.00	1,000.00	6,000.00
202012 140000 7847	300182	捷成股份	2020-12-14	2021-01-11	3.23	1,000.00	3,230.00

202012 140000 7849	300316	晶盛机电	2020-12-14	2021-01-11	30.08	1,000.00	30,080.00
202012 140000 7851	300618	寒锐钴业	2020-12-14	2021-01-11	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 140000 7881	300115	长盈精密	2020-12-14	2021-01-11	24.65	60,000.00	1,479,000.00
202012 140000 7883	300253	卫宁健康	2020-12-14	2021-01-11	17.50	140,000.00	2,450,000.00
202012 140000 7885	300146	汤臣倍健	2020-12-14	2021-01-11	24.15	80,000.00	1,932,000.00
202012 140000 8089	300750	宁德时代	2020-12-14	2021-01-11	351.11	10,000.00	3,511,100.00
202012 140000 8091	300383	光环新网	2020-12-14	2021-01-11	17.17	40,000.00	686,800.00
202012 140000 8093	300601	康泰生物	2020-12-14	2021-01-11	174.50	30,000.00	5,235,000.00
202012 140000 8095	300413	芒果超媒	2020-12-14	2021-01-11	72.50	20,000.00	1,450,000.00
202012 140000 8097	300122	智飞生物	2020-12-14	2021-01-11	147.91	20,000.00	2,958,200.00
202012 140000 8099	300003	乐普医疗	2020-12-14	2021-01-11	27.18	50,000.00	1,359,000.00
202012 140000 8101	300136	信维通信	2020-12-14	2021-01-11	35.88	80,000.00	2,870,400.00
202012 140000 8103	300124	汇川技术	2020-12-14	2021-01-11	93.30	10,000.00	933,000.00
202012 140000 8243	300017	网宿科技	2020-12-14	2021-01-11	6.89	17,000.00	117,130.00
202012 140000	300024	机器人	2020-12-14	2021-01-11	12.30	29,000.00	356,700.00

8245							
202012 140000 8247	300315	掌趣科技	2020-12-14	2021-01-11	5.11	39,000.00	199,290.00
202012 140000 8249	300408	三环集团	2020-12-14	2021-01-11	37.25	20,000.00	745,000.00
202012 140000 8251	300601	康泰生物	2020-12-14	2021-01-11	174.50	10,000.00	1,745,000.00
202012 140000 8253	300433	蓝思科技	2020-12-14	2021-01-11	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 140000 8257	300433	蓝思科技	2020-12-14	2021-01-11	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 140000 8259	300316	晶盛机电	2020-12-14	2021-01-11	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 140000 8261	300418	昆仑万维	2020-12-14	2021-01-11	19.95	10,000.00	199,500.00
202012 140000 8263	300166	东方国信	2020-12-14	2021-01-11	10.95	26,000.00	284,700.00
202012 140000 8265	300033	同花顺	2020-12-14	2021-01-11	123.98	1,000.00	123,980.00
202012 140000 8267	300166	东方国信	2020-12-14	2021-01-11	10.95	33,000.00	361,350.00
202012 140000 8269	300253	卫宁健康	2020-12-14	2021-01-11	17.50	24,000.00	420,000.00
202012 140000 8271	300024	机器人	2020-12-14	2021-01-11	12.30	156,000.00	1,918,800.00
202012 140000 8273	300274	阳光电源	2020-12-14	2021-01-11	72.28	30,000.00	2,168,400.00
202012 140000 8275	300418	昆仑万维	2020-12-14	2021-01-11	19.95	30,000.00	598,500.00
202012	300496	中科创达	2020-12-14	2021-01-	117.00	10,000.00	1,170,000.00

140000 8277				11			0
202012 140000 8279	300315	掌趣科技	2020-12-14	2021-01-11	5.11	117,000.00	597,870.00
202012 140000 8281	300070	碧水源	2020-12-14	2021-01-11	7.65	10,000.00	76,500.00
202012 140000 8283	300115	长盈精密	2020-12-14	2021-01-11	24.65	15,000.00	369,750.00
202012 140000 8285	300136	信维通信	2020-12-14	2021-01-11	35.88	25,000.00	897,000.00
202012 140000 8287	300073	当升科技	2020-12-14	2021-01-11	64.85	30,000.00	1,945,500.00
202012 140000 8289	300073	当升科技	2020-12-14	2021-01-11	64.85	10,000.00	648,500.00
202012 140000 8291	300383	光环新网	2020-12-14	2021-01-11	17.17	35,000.00	600,950.00
202012 140000 8293	300003	乐普医疗	2020-12-14	2021-01-11	27.18	10,000.00	271,800.00
202012 140000 8295	300166	东方国信	2020-12-14	2021-01-11	10.95	25,000.00	273,750.00
202012 140000 8297	300251	光线传媒	2020-12-14	2021-01-11	12.07	30,000.00	362,100.00
202012 140000 8299	300024	机器人	2020-12-14	2021-01-11	12.30	35,000.00	430,500.00
202012 150000 0383	300296	利亚德	2020-12-15	2021-01-12	6.36	362,000.00	2,302,320.00
202012 150000 0385	300558	贝达药业	2020-12-15	2021-01-12	107.37	10,000.00	1,073,700.00
202012 150000 0387	300773	拉卡拉	2020-12-15	2021-01-12	29.92	73,000.00	2,184,160.00

202012 150000 0388	300142	沃森生物	2020-12-15	2021-01-12	38.56	20,000.00	771,200.00
202012 150000 0389	300782	卓胜微	2020-12-15	2021-01-12	570.54	10,000.00	5,705,400.00
202012 150000 0393	300274	阳光电源	2020-12-15	2021-01-12	72.28	10,000.00	722,800.00
202012 150000 0395	300115	长盈精密	2020-12-15	2021-01-12	24.65	1,000.00	24,650.00
202012 150000 0397	300015	爱尔眼科	2020-12-15	2021-01-12	74.89	70,000.00	5,242,300.00
202012 150000 0398	300009	安科生物	2020-12-15	2021-01-12	14.68	10,000.00	146,800.00
202012 150000 0401	300433	蓝思科技	2020-12-15	2021-01-12	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 150000 0403	300296	利亚德	2020-12-15	2021-01-12	6.36	41,000.00	260,760.00
202012 150000 6191	300142	沃森生物	2020-12-15	2021-01-12	38.56	50,000.00	1,928,000.00
202012 150000 6193	300433	蓝思科技	2020-12-15	2021-01-12	30.61	1,000.00	30,610.00
202012 150000 6195	300251	光线传媒	2020-12-15	2021-01-12	12.07	10,000.00	120,700.00
202012 150000 6197	300316	晶盛机电	2020-12-15	2021-01-12	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 150000 6199	300088	长信科技	2020-12-15	2021-01-12	8.89	1,000.00	8,890.00
202012 150000 6257	300750	宁德时代	2020-12-15	2021-01-12	351.11	150,000.00	52,666,500.00
202012 150000	300383	光环新网	2020-12-15	2021-01-12	17.17	14,000.00	240,380.00

6259							
202012 150000 6261	300251	光线传媒	2020-12-15	2021-01-12	12.07	10,000.00	120,700.00
202012 150000 6263	300070	碧水源	2020-12-15	2021-01-12	7.65	50,000.00	382,500.00
202012 150000 6265	300383	光环新网	2020-12-15	2021-01-12	17.17	25,000.00	429,250.00
202012 150000 6267	300015	爱尔眼科	2020-12-15	2021-01-12	74.89	50,000.00	3,744,500.00
202012 150000 6269	300433	蓝思科技	2020-12-15	2021-01-12	30.61	30,000.00	918,300.00
202012 150000 6271	300182	捷成股份	2020-12-15	2021-01-12	3.23	150,000.00	484,500.00
202012 150000 6273	300146	汤臣倍健	2020-12-15	2021-01-12	24.15	26,000.00	627,900.00
202012 150000 6443	300073	当升科技	2020-12-15	2021-01-12	64.85	20,000.00	1,297,000.00
202012 150000 6445	300661	圣邦股份	2020-12-15	2021-01-12	263.80	10,000.00	2,638,000.00
202012 150000 6447	300033	同花顺	2020-12-15	2021-01-12	123.98	10,000.00	1,239,800.00
202012 150000 6449	300070	碧水源	2020-12-15	2021-01-12	7.65	60,000.00	459,000.00
202012 150000 6451	300433	蓝思科技	2020-12-15	2021-01-12	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 150000 6453	300003	乐普医疗	2020-12-15	2021-01-12	27.18	12,000.00	326,160.00
202012 150000 6455	300070	碧水源	2020-12-15	2021-01-12	7.65	19,000.00	145,350.00
202012	300088	长信科技	2020-12-15	2021-01-	8.89	40,000.00	355,600.00

150000 6457				12			
202012 150000 6459	300122	智飞生物	2020-12-15	2021-01-12	147.91	4,000.00	591,640.00
202012 150000 6461	300315	掌趣科技	2020-12-15	2021-01-12	5.11	84,000.00	429,240.00
202012 150000 6463	300182	捷成股份	2020-12-15	2021-01-12	3.23	80,000.00	258,400.00
202012 150000 6465	300618	寒锐钴业	2020-12-15	2021-01-12	94.91	10,000.00	949,100.00
202012 150000 6467	300070	碧水源	2020-12-15	2021-01-12	7.65	52,000.00	397,800.00
202012 150000 6469	300601	康泰生物	2020-12-15	2021-01-12	174.50	10,000.00	1,745,000.00
202012 150000 6687	300433	蓝思科技	2020-12-15	2021-01-12	30.61	30,000.00	918,300.00
202012 160000 0447	300433	蓝思科技	2020-12-16	2021-01-13	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 160000 0449	300015	爱尔眼科	2020-12-16	2021-01-13	74.89	10,000.00	748,900.00
202012 160000 0451	300450	先导智能	2020-12-16	2021-01-13	83.99	12,000.00	1,007,880.00
202012 160000 0453	300750	宁德时代	2020-12-16	2021-01-13	351.11	10,000.00	3,511,100.00
202012 160000 0455	300618	寒锐钴业	2020-12-16	2021-01-13	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 160000 0457	300274	阳光电源	2020-12-16	2021-01-13	72.28	10,000.00	722,800.00
202012 160000 0459	300122	智飞生物	2020-12-16	2021-01-13	147.91	10,000.00	1,479,100.00

202012 160000 0461	300003	乐普医疗	2020-12-16	2021-01-13	27.18	60,000.00	1,630,800.00
202012 160000 0463	300347	泰格医药	2020-12-16	2021-01-13	161.61	20,000.00	3,232,200.00
202012 160000 0465	300558	贝达药业	2020-12-16	2021-01-13	107.37	20,000.00	2,147,400.00
202012 160000 0467	300433	蓝思科技	2020-12-16	2021-01-13	30.61	40,000.00	1,224,400.00
202012 160000 6280	300033	同花顺	2020-12-16	2021-01-13	123.98	1,000.00	123,980.00
202012 160000 6282	300182	捷成股份	2020-12-16	2021-01-13	3.23	10,000.00	32,300.00
202012 160000 6284	300223	北京君正	2020-12-16	2021-01-13	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 160000 6286	300274	阳光电源	2020-12-16	2021-01-13	72.28	30,000.00	2,168,400.00
202012 160000 6288	300316	晶盛机电	2020-12-16	2021-01-13	30.08	1,000.00	30,080.00
202012 160000 6290	300433	蓝思科技	2020-12-16	2021-01-13	30.61	30,000.00	918,300.00
202012 160000 6292	300433	蓝思科技	2020-12-16	2021-01-13	30.61	20,000.00	612,200.00
202012 160000 6302	300003	乐普医疗	2020-12-16	2021-01-13	27.18	18,000.00	489,240.00
202012 160000 6304	300070	碧水源	2020-12-16	2021-01-13	7.65	25,000.00	191,250.00
202012 160000 6306	300122	智飞生物	2020-12-16	2021-01-13	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 160000	300015	爱尔眼科	2020-12-16	2021-01-13	74.89	26,000.00	1,947,140.00

6308							
202012 160000 6310	300433	蓝思科技	2020-12-16	2021-01-13	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 160000 6312	300316	晶盛机电	2020-12-16	2021-01-13	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 160000 6316	300450	先导智能	2020-12-16	2021-01-13	83.99	10,000.00	839,900.00
202012 160000 6318	300418	昆仑万维	2020-12-16	2021-01-13	19.95	50,000.00	997,500.00
202012 160000 6320	300601	康泰生物	2020-12-16	2021-01-13	174.50	10,000.00	1,745,000.00
202012 160000 6414	300748	金力永磁	2020-12-16	2021-01-13	36.34	1,000.00	36,340.00
202012 160000 6430	300124	汇川技术	2020-12-16	2021-01-13	93.30	18,000.00	1,679,400.00
202012 160000 6434	300166	东方国信	2020-12-16	2021-01-13	10.95	12,000.00	131,400.00
202012 160000 6436	300146	汤臣倍健	2020-12-16	2021-01-13	24.15	11,000.00	265,650.00
202012 160000 6440	300136	信维通信	2020-12-16	2021-01-13	35.88	14,000.00	502,320.00
202012 160000 6442	300207	欣旺达	2020-12-16	2021-01-13	30.71	15,000.00	460,650.00
202012 160000 6444	300142	沃森生物	2020-12-16	2021-01-13	38.56	22,000.00	848,320.00
202012 160000 6446	300253	卫宁健康	2020-12-16	2021-01-13	17.50	28,000.00	490,000.00
202012 160000 6448	300347	泰格医药	2020-12-16	2021-01-13	161.61	10,000.00	1,616,100.00
202012	300383	光环新网	2020-12-16	2021-01-	17.17	17,000.00	291,890.00

160000 6450				13			
202012 160000 6452	300274	阳光电源	2020-12-16	2021-01-13	72.28	15,000.00	1,084,200.00
202012 160000 6454	300408	三环集团	2020-12-16	2021-01-13	37.25	18,000.00	670,500.00
202012 160000 6456	300413	芒果超媒	2020-12-16	2021-01-13	72.50	10,000.00	725,000.00
202012 160000 6458	300750	宁德时代	2020-12-16	2021-01-13	351.11	20,000.00	7,022,200.00
202012 160000 6644	300182	捷成股份	2020-12-16	2021-01-13	3.23	100,000.00	323,000.00
202012 160000 6646	300661	圣邦股份	2020-12-16	2021-01-13	263.80	10,000.00	2,638,000.00
202012 160000 6648	300207	欣旺达	2020-12-16	2021-01-13	30.71	20,000.00	614,200.00
202012 160000 6650	300223	北京君正	2020-12-16	2021-01-13	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 160000 6652	300070	碧水源	2020-12-16	2021-01-13	7.65	41,000.00	313,650.00
202012 160000 6654	300383	光环新网	2020-12-16	2021-01-13	17.17	101,000.00	1,734,170.00
202012 160000 6656	300618	寒锐钴业	2020-12-16	2021-01-13	94.91	20,000.00	1,898,200.00
202012 160000 6658	300433	蓝思科技	2020-12-16	2021-01-13	30.61	31,000.00	948,910.00
202012 160000 6660	300207	欣旺达	2020-12-16	2021-01-13	30.71	16,000.00	491,360.00
202012 160000 6662	300418	昆仑万维	2020-12-16	2021-01-13	19.95	100,000.00	1,995,000.00

202012 160000 6664	300315	掌趣科技	2020-12-16	2021-01-13	5.11	128,000.00	654,080.00
202012 160000 6666	300070	碧水源	2020-12-16	2021-01-13	7.65	50,000.00	382,500.00
202012 170000 1032	300558	贝达药业	2020-12-17	2021-01-14	107.37	20,000.00	2,147,400.00
202012 170000 1034	300418	昆仑万维	2020-12-17	2021-01-14	19.95	10,000.00	199,500.00
202012 170000 1035	300122	智飞生物	2020-12-17	2021-01-14	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 170000 1038	300274	阳光电源	2020-12-17	2021-01-14	72.28	5,000.00	361,400.00
202012 170000 1040	300003	乐普医疗	2020-12-17	2021-01-14	27.18	60,000.00	1,630,800.00
202012 170001 0333	300760	迈瑞医疗	2020-12-17	2021-01-14	426.00	10,000.00	4,260,000.00
202012 170001 0335	300496	中科创达	2020-12-17	2021-01-14	117.00	10,000.00	1,170,000.00
202012 170001 0337	300315	掌趣科技	2020-12-17	2021-01-14	5.11	90,000.00	459,900.00
202012 170001 0339	300253	卫宁健康	2020-12-17	2021-01-14	17.50	51,000.00	892,500.00
202012 170001 0341	300122	智飞生物	2020-12-17	2021-01-14	147.91	55,000.00	8,135,050.00
202012 170001 0357	300122	智飞生物	2020-12-17	2021-01-14	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 170001 0359	300136	信维通信	2020-12-17	2021-01-14	35.88	40,000.00	1,435,200.00
202012 170001	300347	泰格医药	2020-12-17	2021-01-14	161.61	20,000.00	3,232,200.00

0361							
202012 170001 0363	300122	智飞生物	2020-12-17	2021-01-14	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 170001 0365	300413	芒果超媒	2020-12-17	2021-01-14	72.50	20,000.00	1,450,000.00
202012 170001 0367	300122	智飞生物	2020-12-17	2021-01-14	147.91	17,000.00	2,514,470.00
202012 170001 0369	300070	碧水源	2020-12-17	2021-01-14	7.65	39,000.00	298,350.00
202012 170001 0371	300315	掌趣科技	2020-12-17	2021-01-14	5.11	49,000.00	250,390.00
202012 170001 0717	300601	康泰生物	2020-12-17	2021-01-14	174.50	10,000.00	1,745,000.00
202012 170001 0719	300070	碧水源	2020-12-17	2021-01-14	7.65	150,000.00	1,147,500.00
202012 170001 0721	300274	阳光电源	2020-12-17	2021-01-14	72.28	10,000.00	722,800.00
202012 170001 0723	300115	长盈精密	2020-12-17	2021-01-14	24.65	10,000.00	246,500.00
202012 170001 0725	300070	碧水源	2020-12-17	2021-01-14	7.65	10,000.00	76,500.00
202012 170001 0727	300182	捷成股份	2020-12-17	2021-01-14	3.23	100,000.00	323,000.00
202012 170001 0729	300418	昆仑万维	2020-12-17	2021-01-14	19.95	20,000.00	399,000.00
202012 170001 0731	300015	爱尔眼科	2020-12-17	2021-01-14	74.89	40,000.00	2,995,600.00
202012 170001 0733	300433	蓝思科技	2020-12-17	2021-01-14	30.61	50,000.00	1,530,500.00
202012	300166	东方国信	2020-12-18	2021-01-	10.95	25,000.00	273,750.00

180000 0731				15			
202012 180000 0733	300115	长盈精密	2020-12-18	2021-01-15	24.65	10,000.00	246,500.00
202012 180000 0735	300207	欣旺达	2020-12-18	2021-01-15	30.71	15,000.00	460,650.00
202012 180000 0737	300666	江丰电子	2020-12-18	2021-01-15	49.51	1,000.00	49,510.00
202012 180000 0739	300253	卫宁健康	2020-12-18	2021-01-15	17.50	13,000.00	227,500.00
202012 180000 0741	300122	智飞生物	2020-12-18	2021-01-15	147.91	12,000.00	1,774,920.00
202012 180000 0743	300088	长信科技	2020-12-18	2021-01-15	8.89	100,000.00	889,000.00
202012 180000 0745	300251	光线传媒	2020-12-18	2021-01-15	12.07	10,000.00	120,700.00
202012 180000 0747	300418	昆仑万维	2020-12-18	2021-01-15	19.95	50,000.00	997,500.00
202012 180000 0749	300296	利亚德	2020-12-18	2021-01-15	6.36	10,000.00	63,600.00
202012 180000 8311	300142	沃森生物	2020-12-18	2021-01-15	38.56	35,000.00	1,349,600.00
202012 180000 8313	300433	蓝思科技	2020-12-18	2021-01-15	30.61	15,000.00	459,150.00
202012 180000 8315	300748	金力永磁	2020-12-18	2021-01-15	36.34	10,000.00	363,400.00
202012 180000 8317	300024	机器人	2020-12-18	2021-01-15	12.30	22,000.00	270,600.00
202012 180000 8319	300315	掌趣科技	2020-12-18	2021-01-15	5.11	63,000.00	321,930.00

202012 180000 8395	300274	阳光电源	2020-12-18	2021-01-15	72.28	51,000.00	3,686,280.00
202012 180000 8397	300182	捷成股份	2020-12-18	2021-01-15	3.23	70,000.00	226,100.00
202012 180000 8399	300383	光环新网	2020-12-18	2021-01-15	17.17	10,000.00	171,700.00
202012 180000 8401	300433	蓝思科技	2020-12-18	2021-01-15	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 180000 8403	300418	昆仑万维	2020-12-18	2021-01-15	19.95	37,000.00	738,150.00
202012 180000 8405	300618	寒锐钴业	2020-12-18	2021-01-15	94.91	10,000.00	949,100.00
202012 180000 8407	300676	华大基因	2020-12-18	2021-01-15	128.56	20,000.00	2,571,200.00
202012 180000 8409	300182	捷成股份	2020-12-18	2021-01-15	3.23	170,000.00	549,100.00
202012 180000 8411	300136	信维通信	2020-12-18	2021-01-15	35.88	10,000.00	358,800.00
202012 180000 8413	300122	智飞生物	2020-12-18	2021-01-15	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 180000 8415	300058	蓝色光标	2020-12-18	2021-01-15	6.00	110,000.00	660,000.00
202012 180000 8529	300748	金力永磁	2020-12-18	2021-01-15	36.34	10,000.00	363,400.00
202012 180000 8531	300418	昆仑万维	2020-12-18	2021-01-15	19.95	20,000.00	399,000.00
202012 180000 8533	300316	晶盛机电	2020-12-18	2021-01-15	30.08	1,000.00	30,080.00
202012 180000	300182	捷成股份	2020-12-18	2021-01-15	3.23	50,000.00	161,500.00

8535							
202012 180000 8537	300058	蓝色光标	2020-12-18	2021-01-15	6.00	10,000.00	60,000.00
202012 180000 8567	300274	阳光电源	2020-12-18	2021-01-15	72.28	10,000.00	722,800.00
202012 180000 8569	300088	长信科技	2020-12-18	2021-01-15	8.89	10,000.00	88,900.00
202012 180000 8571	300433	蓝思科技	2020-12-18	2021-01-15	30.61	1,000.00	30,610.00
202012 180000 8573	300223	北京君正	2020-12-18	2021-01-15	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 180000 8575	300059	东方财富	2020-12-18	2021-01-15	31.00	31,000.00	961,000.00
202012 210000 0624	300017	网宿科技	2020-12-21	2021-01-18	6.89	80,000.00	551,200.00
202012 210000 0626	300014	亿纬锂能	2020-12-21	2021-01-18	81.50	27,000.00	2,200,500.00
202012 210000 0628	300347	泰格医药	2020-12-21	2021-01-18	161.61	13,000.00	2,100,930.00
202012 210000 0630	300558	贝达药业	2020-12-21	2021-01-18	107.37	10,000.00	1,073,700.00
202012 210000 0631	300223	北京君正	2020-12-21	2021-01-18	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 210000 0634	300274	阳光电源	2020-12-21	2021-01-18	72.28	10,000.00	722,800.00
202012 210000 0636	300433	蓝思科技	2020-12-21	2021-01-18	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 210000 0638	300418	昆仑万维	2020-12-21	2021-01-18	19.95	10,000.00	199,500.00
202012	300383	光环新网	2020-12-21	2021-01-	17.17	50,000.00	858,500.00

210000 0640				18			
202012 210000 0642	300251	光线传媒	2020-12-21	2021-01-18	12.07	10,000.00	120,700.00
202012 210000 0644	300274	阳光电源	2020-12-21	2021-01-18	72.28	44,000.00	3,180,320.00
202012 210000 0646	300142	沃森生物	2020-12-21	2021-01-18	38.56	1,000.00	38,560.00
202012 210000 0648	300073	当升科技	2020-12-21	2021-01-18	64.85	1,000.00	64,850.00
202012 210000 0650	300059	东方财富	2020-12-21	2021-01-18	31.00	13,000.00	403,000.00
202012 210000 0652	300433	蓝思科技	2020-12-21	2021-01-18	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 210000 5861	300450	先导智能	2020-12-21	2021-01-18	83.99	15,000.00	1,259,850.00
202012 210000 5863	300124	汇川技术	2020-12-21	2021-01-18	93.30	35,000.00	3,265,500.00
202012 210000 5865	300146	汤臣倍健	2020-12-21	2021-01-18	24.15	25,000.00	603,750.00
202012 210000 5867	300418	昆仑万维	2020-12-21	2021-01-18	19.95	10,000.00	199,500.00
202012 210000 5869	300166	东方国信	2020-12-21	2021-01-18	10.95	25,000.00	273,750.00
202012 210000 5871	300433	蓝思科技	2020-12-21	2021-01-18	30.61	35,000.00	1,071,350.00
202012 210000 5873	300122	智飞生物	2020-12-21	2021-01-18	147.91	7,000.00	1,035,370.00
202012 210000 5875	300207	欣旺达	2020-12-21	2021-01-18	30.71	20,000.00	614,200.00

202012 210000 6081	300003	乐普医疗	2020-12-21	2021-01-18	27.18	3,000.00	81,540.00
202012 210000 6083	300748	金力永磁	2020-12-21	2021-01-18	36.34	10,000.00	363,400.00
202012 210000 6085	300017	网宿科技	2020-12-21	2021-01-18	6.89	161,000.00	1,109,290.00
202012 210000 6087	300024	机器人	2020-12-21	2021-01-18	12.30	10,000.00	123,000.00
202012 210000 6089	300058	蓝色光标	2020-12-21	2021-01-18	6.00	10,000.00	60,000.00
202012 210000 6091	300433	蓝思科技	2020-12-21	2021-01-18	30.61	15,000.00	459,150.00
202012 210000 6093	300251	光线传媒	2020-12-21	2021-01-18	12.07	1,000.00	12,070.00
202012 210000 6095	300223	北京君正	2020-12-21	2021-01-18	91.49	10,000.00	914,900.00
202012 210000 6097	300223	北京君正	2020-12-21	2021-01-18	91.49	5,000.00	457,450.00
202012 210000 6099	300750	宁德时代	2020-12-21	2021-01-18	351.11	2,000.00	702,220.00
202012 210000 6101	300567	精测电子	2020-12-21	2021-01-18	54.94	10,000.00	549,400.00
202012 210000 6103	300661	圣邦股份	2020-12-21	2021-01-18	263.80	10,000.00	2,638,000.00
202012 210000 6105	300136	信维通信	2020-12-21	2021-01-18	35.88	25,000.00	897,000.00
202012 210000 6107	300182	捷成股份	2020-12-21	2021-01-18	3.23	55,000.00	177,650.00
202012 210000	300496	中科创达	2020-12-21	2021-01-18	117.00	10,000.00	1,170,000.00

6109							
202012 210000 6111	300253	卫宁健康	2020-12-21	2021-01-18	17.50	50,000.00	875,000.00
202012 210000 6113	300274	阳光电源	2020-12-21	2021-01-18	72.28	30,000.00	2,168,400.00
202012 210000 6115	300347	泰格医药	2020-12-21	2021-01-18	161.61	15,000.00	2,424,150.00
202012 210000 6117	300383	光环新网	2020-12-21	2021-01-18	17.17	35,000.00	600,950.00
202012 210000 6119	300408	三环集团	2020-12-21	2021-01-18	37.25	30,000.00	1,117,500.00
202012 210000 6121	300413	芒果超媒	2020-12-21	2021-01-18	72.50	20,000.00	1,450,000.00
202012 210000 6123	300750	宁德时代	2020-12-21	2021-01-18	351.11	5,000.00	1,755,550.00
202012 210000 6125	300070	碧水源	2020-12-21	2021-01-18	7.65	50,000.00	382,500.00
202012 210000 6127	300601	康泰生物	2020-12-21	2021-01-18	174.50	10,000.00	1,745,000.00
202012 210000 6129	300666	江丰电子	2020-12-21	2021-01-18	49.51	10,000.00	495,100.00
202012 210000 6131	300676	华大基因	2020-12-21	2021-01-18	128.56	10,000.00	1,285,600.00
202012 210000 6133	300760	迈瑞医疗	2020-12-21	2021-01-18	426.00	10,000.00	4,260,000.00
202012 210000 6135	300618	寒锐钴业	2020-12-21	2021-01-18	94.91	10,000.00	949,100.00
202012 210000 6139	300033	同花顺	2020-12-21	2021-01-18	123.98	10,000.00	1,239,800.00
202012	300059	东方财富	2020-12-21	2021-01-	31.00	10,000.00	310,000.00

210000 6141				18			
202012 210000 6143	300088	长信科技	2020-12-21	2021-01-18	8.89	50,000.00	444,500.00
202012 210000 6145	300223	北京君正	2020-12-21	2021-01-18	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 210000 6147	300433	蓝思科技	2020-12-21	2021-01-18	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 210000 6149	300618	寒锐钴业	2020-12-21	2021-01-18	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 210000 6151	300748	金力永磁	2020-12-21	2021-01-18	36.34	10,000.00	363,400.00
202012 210000 6159	300003	乐普医疗	2020-12-21	2021-01-18	27.18	35,000.00	951,300.00
202012 210000 6161	300033	同花顺	2020-12-21	2021-01-18	123.98	10,000.00	1,239,800.00
202012 210000 6163	300015	爱尔眼科	2020-12-21	2021-01-18	74.89	50,000.00	3,744,500.00
202012 220000 0909	300142	沃森生物	2020-12-22	2021-01-19	38.56	1,000.00	38,560.00
202012 220000 0911	300073	当升科技	2020-12-22	2021-01-19	64.85	5,000.00	324,250.00
202012 220000 0913	300122	智飞生物	2020-12-22	2021-01-19	147.91	26,000.00	3,845,660.00
202012 220000 0915	300014	亿纬锂能	2020-12-22	2021-01-19	81.50	10,000.00	815,000.00
202012 220000 0916	300750	宁德时代	2020-12-22	2021-01-19	351.11	2,000.00	702,220.00
202012 220000 0919	300142	沃森生物	2020-12-22	2021-01-19	38.56	1,000.00	38,560.00

202012 220000 0921	300207	欣旺达	2020-12-22	2021-01-19	30.71	43,000.00	1,320,530.00
202012 220000 0923	300748	金力永磁	2020-12-22	2021-01-19	36.34	12,000.00	436,080.00
202012 220000 0925	300223	北京君正	2020-12-22	2021-01-19	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 220000 0926	300182	捷成股份	2020-12-22	2021-01-19	3.23	200,000.00	646,000.00
202012 220000 0929	300223	北京君正	2020-12-22	2021-01-19	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 220000 0931	300418	昆仑万维	2020-12-22	2021-01-19	19.95	50,000.00	997,500.00
202012 220000 0933	300122	智飞生物	2020-12-22	2021-01-19	147.91	12,000.00	1,774,920.00
202012 220000 0935	300782	卓胜微	2020-12-22	2021-01-19	570.54	10,000.00	5,705,400.00
202012 220000 0937	300274	阳光电源	2020-12-22	2021-01-19	72.28	11,000.00	795,080.00
202012 220000 0939	300142	沃森生物	2020-12-22	2021-01-19	38.56	1,000.00	38,560.00
202012 220000 0941	300748	金力永磁	2020-12-22	2021-01-19	36.34	1,000.00	36,340.00
202012 220000 0943	300433	蓝思科技	2020-12-22	2021-01-19	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 220000 0945	300024	机器人	2020-12-22	2021-01-19	12.30	10,000.00	123,000.00
202012 220000 0947	300033	同花顺	2020-12-22	2021-01-19	123.98	10,000.00	1,239,800.00
202012 220001	300383	光环新网	2020-12-22	2021-01-19	17.17	48,000.00	824,160.00

0173							
202012 220001 0175	300433	蓝思科技	2020-12-22	2021-01-19	30.61	20,000.00	612,200.00
202012 220001 0177	300033	同花顺	2020-12-22	2021-01-19	123.98	2,000.00	247,960.00
202012 220001 0179	300122	智飞生物	2020-12-22	2021-01-19	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 220001 0181	300666	江丰电子	2020-12-22	2021-01-19	49.51	2,000.00	99,020.00
202012 220001 0183	300166	东方国信	2020-12-22	2021-01-19	10.95	62,000.00	678,900.00
202012 220001 0185	300433	蓝思科技	2020-12-22	2021-01-19	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 220001 0187	300033	同花顺	2020-12-22	2021-01-19	123.98	2,000.00	247,960.00
202012 220001 0189	300088	长信科技	2020-12-22	2021-01-19	8.89	10,000.00	88,900.00
202012 220001 0191	300274	阳光电源	2020-12-22	2021-01-19	72.28	1,000.00	72,280.00
202012 220001 0193	300136	信维通信	2020-12-22	2021-01-19	35.88	20,000.00	717,600.00
202012 220001 0195	300088	长信科技	2020-12-22	2021-01-19	8.89	10,000.00	88,900.00
202012 220001 0197	300316	晶盛机电	2020-12-22	2021-01-19	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 220001 0231	300223	北京君正	2020-12-22	2021-01-19	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 220001 0233	300014	亿纬锂能	2020-12-22	2021-01-19	81.50	7,000.00	570,500.00
202012	300274	阳光电源	2020-12-22	2021-01-	72.28	10,000.00	722,800.00

220001 0583				19			
202012 220001 0585	300433	蓝思科技	2020-12-22	2021-01-19	30.61	1,000.00	30,610.00
202012 220001 0587	300618	寒锐钴业	2020-12-22	2021-01-19	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 230000 1000	300088	长信科技	2020-12-23	2021-01-06	8.89	115,000.00	1,022,350.00
202012 230000 1002	300009	安科生物	2020-12-23	2021-01-06	14.68	131,000.00	1,923,080.00
202012 230000 1004	300115	长盈精密	2020-12-23	2021-01-06	24.65	18,000.00	443,700.00
202012 230000 1006	300207	欣旺达	2020-12-23	2021-01-06	30.71	44,000.00	1,351,240.00
202012 230000 1008	300166	东方国信	2020-12-23	2021-01-06	10.95	31,000.00	339,450.00
202012 230000 1010	300315	掌趣科技	2020-12-23	2021-01-06	5.11	10,000.00	51,100.00
202012 230000 1012	300251	光线传媒	2020-12-23	2021-01-06	12.07	10,000.00	120,700.00
202012 230000 1013	300115	长盈精密	2020-12-23	2021-01-06	24.65	10,000.00	246,500.00
202012 230000 1016	300558	贝达药业	2020-12-23	2021-01-06	107.37	20,000.00	2,147,400.00
202012 230000 1018	300316	晶盛机电	2020-12-23	2021-01-06	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 230000 1020	300383	光环新网	2020-12-23	2021-01-06	17.17	2,000.00	34,340.00
202012 230000 1022	300433	蓝思科技	2020-12-23	2021-01-06	30.61	10,000.00	306,100.00

202012 230000 1024	300274	阳光电源	2020-12-23	2021-01-06	72.28	15,000.00	1,084,200.00
202012 230000 1026	300223	北京君正	2020-12-23	2021-01-06	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 230000 1028	300413	芒果超媒	2020-12-23	2021-01-06	72.50	12,000.00	870,000.00
202012 230000 1030	300760	迈瑞医疗	2020-12-23	2021-01-06	426.00	1,000.00	426,000.00
202012 230000 1032	300136	信维通信	2020-12-23	2021-01-06	35.88	50,000.00	1,794,000.00
202012 230000 1034	300122	智飞生物	2020-12-23	2021-01-06	147.91	5,000.00	739,550.00
202012 230000 1036	300433	蓝思科技	2020-12-23	2021-01-06	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 230000 1038	300601	康泰生物	2020-12-23	2021-01-06	174.50	5,000.00	872,500.00
202012 230000 1040	300408	三环集团	2020-12-23	2021-01-06	37.25	50,000.00	1,862,500.00
202012 230000 7418	300748	金力永磁	2020-12-23	2021-01-20	36.34	1,000.00	36,340.00
202012 230000 7420	300618	寒锐钴业	2020-12-23	2021-01-20	94.91	10,000.00	949,100.00
202012 230000 7422	300450	先导智能	2020-12-23	2021-01-20	83.99	10,000.00	839,900.00
202012 230000 7424	300433	蓝思科技	2020-12-23	2021-01-20	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 230000 7426	300433	蓝思科技	2020-12-23	2021-01-20	30.61	50,000.00	1,530,500.00
202012 230000	300274	阳光电源	2020-12-23	2021-01-20	72.28	60,000.00	4,336,800.00

7428							
202012 230000 7430	300088	长信科技	2020-12-23	2021-01-20	8.89	30,000.00	266,700.00
202012 230000 7432	300033	同花顺	2020-12-23	2021-01-20	123.98	10,000.00	1,239,800.00
202012 230000 7436	300059	东方财富	2020-12-23	2021-01-20	31.00	149,000.00	4,619,000.00
202012 230000 7438	300748	金力永磁	2020-12-23	2021-01-20	36.34	10,000.00	363,400.00
202012 230000 7440	300207	欣旺达	2020-12-23	2021-01-20	30.71	12,000.00	368,520.00
202012 230000 7442	300666	江丰电子	2020-12-23	2021-01-20	49.51	10,000.00	495,100.00
202012 230000 7444	300750	宁德时代	2020-12-23	2021-01-20	351.11	25,000.00	8,777,750.00
202012 230000 7446	300661	圣邦股份	2020-12-23	2021-01-20	263.80	10,000.00	2,638,000.00
202012 230000 7448	300676	华大基因	2020-12-23	2021-01-20	128.56	10,000.00	1,285,600.00
202012 230000 7450	300601	康泰生物	2020-12-23	2021-01-20	174.50	10,000.00	1,745,000.00
202012 230000 7452	300496	中科创达	2020-12-23	2021-01-20	117.00	10,000.00	1,170,000.00
202012 230000 7454	300618	寒锐钴业	2020-12-23	2021-01-20	94.91	10,000.00	949,100.00
202012 230000 7456	300567	精测电子	2020-12-23	2021-01-20	54.94	10,000.00	549,400.00
202012 230000 7458	300450	先导智能	2020-12-23	2021-01-20	83.99	15,000.00	1,259,850.00
202012	300418	昆仑万维	2020-12-23	2021-01-	19.95	15,000.00	299,250.00

230000 7460				20			
202012 230000 7462	300413	芒果超媒	2020-12-23	2021-01-20	72.50	20,000.00	1,450,000.00
202012 230000 7464	300383	光环新网	2020-12-23	2021-01-20	17.17	35,000.00	600,950.00
202012 230000 7466	300408	三环集团	2020-12-23	2021-01-20	37.25	30,000.00	1,117,500.00
202012 230000 7468	300433	蓝思科技	2020-12-23	2021-01-20	30.61	35,000.00	1,071,350.00
202012 230000 7470	300347	泰格医药	2020-12-23	2021-01-20	161.61	15,000.00	2,424,150.00
202012 230000 7472	300253	卫宁健康	2020-12-23	2021-01-20	17.50	50,000.00	875,000.00
202012 230000 7474	300316	晶盛机电	2020-12-23	2021-01-20	30.08	20,000.00	601,600.00
202012 230000 7476	300274	阳光电源	2020-12-23	2021-01-20	72.28	30,000.00	2,168,400.00
202012 230000 7478	300166	东方国信	2020-12-23	2021-01-20	10.95	25,000.00	273,750.00
202012 230000 7480	300223	北京君正	2020-12-23	2021-01-20	91.49	10,000.00	914,900.00
202012 230000 7482	300182	捷成股份	2020-12-23	2021-01-20	3.23	55,000.00	177,650.00
202012 230000 7484	300136	信维通信	2020-12-23	2021-01-20	35.88	25,000.00	897,000.00
202012 230000 7486	300207	欣旺达	2020-12-23	2021-01-20	30.71	30,000.00	921,300.00
202012 230000 7488	300146	汤臣倍健	2020-12-23	2021-01-20	24.15	25,000.00	603,750.00

202012 230000 7490	300122	智飞生物	2020-12-23	2021-01-20	147.91	15,000.00	2,218,650.00
202012 230000 7492	300070	碧水源	2020-12-23	2021-01-20	7.65	50,000.00	382,500.00
202012 230000 7494	300059	东方财富	2020-12-23	2021-01-20	31.00	185,000.00	5,735,000.00
202012 230000 7496	300115	长盈精密	2020-12-23	2021-01-20	24.65	15,000.00	369,750.00
202012 230000 7498	300033	同花顺	2020-12-23	2021-01-20	123.98	10,000.00	1,239,800.00
202012 230000 7500	300014	亿纬锂能	2020-12-23	2021-01-20	81.50	35,000.00	2,852,500.00
202012 230000 7502	300124	汇川技术	2020-12-23	2021-01-20	93.30	35,000.00	3,265,500.00
202012 230000 7504	300088	长信科技	2020-12-23	2021-01-20	8.89	65,000.00	577,850.00
202012 230000 7506	300024	机器人	2020-12-23	2021-01-20	12.30	150,000.00	1,845,000.00
202012 230000 7508	300003	乐普医疗	2020-12-23	2021-01-20	27.18	35,000.00	951,300.00
202012 230000 7510	300017	网宿科技	2020-12-23	2021-01-20	6.89	60,000.00	413,400.00
202012 230000 7524	300015	爱尔眼科	2020-12-23	2021-01-20	74.89	50,000.00	3,744,500.00
202012 230000 7526	300073	当升科技	2020-12-23	2021-01-06	64.85	10,000.00	648,500.00
202012 230000 7528	300115	长盈精密	2020-12-23	2021-01-06	24.65	10,000.00	246,500.00
202012 230000	300207	欣旺达	2020-12-23	2021-01-06	30.71	7,000.00	214,970.00

7530							
202012 230000 7532	300182	捷成股份	2020-12-23	2021-01-07	3.23	10,000.00	32,300.00
202012 230000 7534	300251	光线传媒	2020-12-23	2021-01-06	12.07	10,000.00	120,700.00
202012 230000 7610	300059	东方财富	2020-12-23	2021-01-20	31.00	44,000.00	1,364,000.00
202012 230000 7612	300113	顺网科技	2020-12-23	2021-01-20	17.15	30,000.00	514,500.00
202012 230000 7614	300122	智飞生物	2020-12-23	2021-01-20	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 230000 7616	300142	沃森生物	2020-12-23	2021-01-20	38.56	22,000.00	848,320.00
202012 230000 7618	300433	蓝思科技	2020-12-23	2021-01-20	30.61	50,000.00	1,530,500.00
202012 230000 7620	300024	机器人	2020-12-23	2021-01-20	12.30	100,000.00	1,230,000.00
202012 230000 7622	300274	阳光电源	2020-12-23	2021-01-20	72.28	7,000.00	505,960.00
202012 230000 7624	300433	蓝思科技	2020-12-23	2021-01-20	30.61	60,000.00	1,836,600.00
202012 240000 1084	300223	北京君正	2020-12-24	2021-01-21	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 240000 1086	300113	顺网科技	2020-12-24	2021-01-21	17.15	10,000.00	171,500.00
202012 240000 1087	300274	阳光电源	2020-12-24	2021-01-21	72.28	1,000.00	72,280.00
202012 240000 1089	300618	寒锐钴业	2020-12-24	2021-01-21	94.91	1,000.00	94,910.00
202012	300207	欣旺达	2020-12-24	2021-01-	30.71	10,000.00	307,100.00

240000 1092				21			
202012 240000 1094	300251	光线传媒	2020-12-24	2021-01-21	12.07	10,000.00	120,700.00
202012 240000 1096	300433	蓝思科技	2020-12-24	2021-01-21	30.61	1,000.00	30,610.00
202012 240000 1097	300316	晶盛机电	2020-12-24	2021-01-21	30.08	20,000.00	601,600.00
202012 240000 1099	300142	沃森生物	2020-12-24	2021-01-21	38.56	5,000.00	192,800.00
202012 240000 1102	300122	智飞生物	2020-12-24	2021-01-21	147.91	12,000.00	1,774,920.00
202012 240000 1104	300408	三环集团	2020-12-24	2021-01-21	37.25	1,000.00	37,250.00
202012 240000 1106	300015	爱尔眼科	2020-12-24	2021-01-21	74.89	1,000.00	74,890.00
202012 240000 1107	300033	同花顺	2020-12-24	2021-01-21	123.98	1,000.00	123,980.00
202012 240000 1110	300601	康泰生物	2020-12-24	2021-01-21	174.50	1,000.00	174,500.00
202012 240000 1111	300136	信维通信	2020-12-24	2021-01-21	35.88	1,000.00	35,880.00
202012 240000 1114	300618	寒锐钴业	2020-12-24	2021-01-21	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 240001 3275	300748	金力永磁	2020-12-24	2021-01-21	36.34	1,000.00	36,340.00
202012 240001 3277	300618	寒锐钴业	2020-12-24	2021-01-21	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 240001 3279	300223	北京君正	2020-12-24	2021-01-21	91.49	1,000.00	91,490.00

202012 240001 3281	300017	网宿科技	2020-12-24	2021-01-21	6.89	10,000.00	68,900.00
202012 240001 3283	300166	东方国信	2020-12-24	2021-01-21	10.95	31,000.00	339,450.00
202012 240001 3285	300433	蓝思科技	2020-12-24	2021-01-21	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 240001 3287	300073	当升科技	2020-12-24	2021-01-21	64.85	20,000.00	1,297,000.00
202012 240001 3289	300750	宁德时代	2020-12-24	2021-01-21	351.11	40,000.00	14,044,400.00
202012 240001 3291	300496	中科创达	2020-12-24	2021-01-21	117.00	20,000.00	2,340,000.00
202012 240001 3293	300073	当升科技	2020-12-24	2021-01-21	64.85	17,000.00	1,102,450.00
202012 240001 3295	300760	迈瑞医疗	2020-12-24	2021-01-21	426.00	30,000.00	12,780,000.00
202012 240001 3297	300059	东方财富	2020-12-24	2021-01-21	31.00	300,000.00	9,300,000.00
202012 240001 3299	300142	沃森生物	2020-12-24	2021-01-21	38.56	10,000.00	385,600.00
202012 240001 3301	300316	晶盛机电	2020-12-24	2021-01-21	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 240001 3481	300003	乐普医疗	2020-12-24	2021-01-21	27.18	60,000.00	1,630,800.00
202012 250000 0646	300182	捷成股份	2020-12-25	2021-01-19	3.23	50,000.00	161,500.00
202012 250000 0648	300496	中科创达	2020-12-25	2021-01-19	117.00	10,000.00	1,170,000.00
202012 250000	300251	光线传媒	2020-12-25	2021-01-19	12.07	1,000.00	12,070.00

0650							
202012 250000 0652	300142	沃森生物	2020-12-25	2021-01-19	38.56	100,000.00	3,856,000.00
202012 250000 0654	300058	蓝色光标	2020-12-25	2021-01-19	6.00	30,000.00	180,000.00
202012 250000 0656	300408	三环集团	2020-12-25	2021-01-19	37.25	100,000.00	3,725,000.00
202012 250000 0658	300015	爱尔眼科	2020-12-25	2021-01-19	74.89	100,000.00	7,489,000.00
202012 250000 0660	300136	信维通信	2020-12-25	2021-01-19	35.88	50,000.00	1,794,000.00
202012 250000 0662	300773	拉卡拉	2020-12-25	2021-01-19	29.92	10,000.00	299,200.00
202012 250000 0664	300274	阳光电源	2020-12-25	2021-01-19	72.28	1,000.00	72,280.00
202012 250000 6589	300073	当升科技	2020-12-25	2021-01-08	64.85	10,000.00	648,500.00
202012 250000 6591	300207	欣旺达	2020-12-25	2021-01-08	30.71	10,000.00	307,100.00
202012 250000 6593	300088	长信科技	2020-12-25	2021-01-08	8.89	30,000.00	266,700.00
202012 250000 6595	300450	先导智能	2020-12-25	2021-01-22	83.99	120,000.00	10,078,800.00
202012 250000 6597	300142	沃森生物	2020-12-25	2021-01-08	38.56	10,000.00	385,600.00
202012 250000 6599	300113	顺网科技	2020-12-25	2021-01-08	17.15	10,000.00	171,500.00
202012 250000 6683	300413	芒果超媒	2020-12-25	2021-01-22	72.50	20,000.00	1,450,000.00
202012	300017	网宿科技	2020-12-25	2021-01-	6.89	100,000.00	689,000.00

250000 6685				22			
202012 250000 6687	300750	宁德时代	2020-12-25	2021-01-22	351.11	10,000.00	3,511,100.00
202012 250000 6689	300253	卫宁健康	2020-12-25	2021-01-22	17.50	140,000.00	2,450,000.00
202012 250000 6691	300115	长盈精密	2020-12-25	2021-01-22	24.65	60,000.00	1,479,000.00
202012 250000 6693	300383	光环新网	2020-12-25	2021-01-22	17.17	40,000.00	686,800.00
202012 250000 6695	300146	汤臣倍健	2020-12-25	2021-01-22	24.15	80,000.00	1,932,000.00
202012 250000 6697	300166	东方国信	2020-12-25	2021-01-22	10.95	100,000.00	1,095,000.00
202012 250000 6699	300316	晶盛机电	2020-12-25	2021-01-22	30.08	130,000.00	3,910,400.00
202012 250000 6701	300014	亿纬锂能	2020-12-25	2021-01-22	81.50	280,000.00	22,820,000.00
202012 250000 6705	300124	汇川技术	2020-12-25	2021-01-22	93.30	10,000.00	933,000.00
202012 250000 6707	300070	碧水源	2020-12-25	2021-01-22	7.65	180,000.00	1,377,000.00
202012 250000 6709	300601	康泰生物	2020-12-25	2021-01-22	174.50	30,000.00	5,235,000.00
202012 250000 6711	300136	信维通信	2020-12-25	2021-01-22	35.88	80,000.00	2,870,400.00
202012 250000 6713	300003	乐普医疗	2020-12-25	2021-01-22	27.18	50,000.00	1,359,000.00
202012 250000 6715	300122	智飞生物	2020-12-25	2021-01-22	147.91	20,000.00	2,958,200.00

202012 250000 6717	300567	精测电子	2020-12-25	2021-01- 22	54.94	10,000.00	549,400.00
202012 280000 0561	300496	中科创达	2020-12-28	2021-01- 06	117.00	7,000.00	819,000.00
202012 280000 0563	300315	掌趣科技	2020-12-28	2021-01- 06	5.11	3,000.00	15,330.00
202012 280000 0565	300782	卓胜微	2020-12-28	2021-01- 06	570.54	1,000.00	570,540.00
202012 280000 0567	300207	欣旺达	2020-12-28	2021-01- 06	30.71	30,000.00	921,300.00
202012 280000 0569	300059	东方财富	2020-12-28	2021-01- 06	31.00	40,000.00	1,240,000.0 0
202012 280000 0571	300017	网宿科技	2020-12-28	2021-01- 06	6.89	1,000.00	6,890.00
202012 280000 0573	300347	泰格医药	2020-12-28	2021-01- 06	161.61	2,000.00	323,220.00
202012 280000 0575	300070	碧水源	2020-12-28	2021-01- 06	7.65	1,000.00	7,650.00
202012 280000 0577	300122	智飞生物	2020-12-28	2021-01- 06	147.91	5,000.00	739,550.00
202012 280000 0579	300142	沃森生物	2020-12-28	2021-01- 06	38.56	50,000.00	1,928,000.0 0
202012 280000 0581	300014	亿纬锂能	2020-12-28	2021-01- 06	81.50	3,000.00	244,500.00
202012 280000 0583	300676	华大基因	2020-12-28	2021-01- 06	128.56	5,000.00	642,800.00
202012 280000 0585	300015	爱尔眼科	2020-12-28	2021-01- 25	74.89	3,000.00	224,670.00
202012 280000	300782	卓胜微	2020-12-28	2021-01- 25	570.54	5,000.00	2,852,700.0 0

0587							
202012 280000 0589	300014	亿纬锂能	2020-12-28	2021-01-25	81.50	20,000.00	1,630,000.00
202012 280000 0591	300251	光线传媒	2020-12-28	2021-01-25	12.07	1,000.00	12,070.00
202012 280000 0593	300433	蓝思科技	2020-12-28	2021-01-25	30.61	10,000.00	306,100.00
202012 280000 0595	300182	捷成股份	2020-12-28	2021-01-07	3.23	50,000.00	161,500.00
202012 280000 0597	300014	亿纬锂能	2020-12-28	2021-01-25	81.50	10,000.00	815,000.00
202012 280000 0599	300618	寒锐钴业	2020-12-28	2021-01-25	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 280000 0601	300142	沃森生物	2020-12-28	2021-01-25	38.56	1,000.00	38,560.00
202012 280000 0603	300073	当升科技	2020-12-28	2021-01-25	64.85	1,000.00	64,850.00
202012 280000 0605	300122	智飞生物	2020-12-28	2021-01-25	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 280000 7855	300750	宁德时代	2020-12-28	2021-01-25	351.11	55,000.00	19,311,050.00
202012 280000 7857	300748	金力永磁	2020-12-28	2021-01-25	36.34	21,000.00	763,140.00
202012 280000 7859	300676	华大基因	2020-12-28	2021-01-25	128.56	15,000.00	1,928,400.00
202012 280000 7861	300666	江丰电子	2020-12-28	2021-01-25	49.51	16,000.00	792,160.00
202012 280000 7863	300618	寒锐钴业	2020-12-28	2021-01-25	94.91	10,000.00	949,100.00
202012	300601	康泰生物	2020-12-28	2021-01-	174.50	24,000.00	4,188,000.00

280000 7865				25			0
202012 280000 7867	300496	中科创达	2020-12-28	2021-01-25	117.00	20,000.00	2,340,000.00
202012 280000 7869	300433	蓝思科技	2020-12-28	2021-01-25	30.61	74,000.00	2,265,140.00
202012 280000 7871	300418	昆仑万维	2020-12-28	2021-01-25	19.95	39,000.00	778,050.00
202012 280000 7873	300413	芒果超媒	2020-12-28	2021-01-25	72.50	51,000.00	3,697,500.00
202012 280000 7875	300316	晶盛机电	2020-12-28	2021-01-25	30.08	42,000.00	1,263,360.00
202012 280000 7877	300315	掌趣科技	2020-12-28	2021-01-25	5.11	218,000.00	1,113,980.00
202012 280000 7879	300182	捷成股份	2020-12-28	2021-01-25	3.23	98,000.00	316,540.00
202012 280000 7881	300166	东方国信	2020-12-28	2021-01-25	10.95	58,000.00	635,100.00
202012 280000 7883	300146	汤臣倍健	2020-12-28	2021-01-25	24.15	51,000.00	1,231,650.00
202012 280000 7885	300142	沃森生物	2020-12-28	2021-01-25	38.56	121,000.00	4,665,760.00
202012 280000 7887	300136	信维通信	2020-12-28	2021-01-25	35.88	68,000.00	2,439,840.00
202012 280000 7959	300124	汇川技术	2020-12-28	2021-01-25	93.30	10,000.00	933,000.00
202012 280000 7961	300014	亿纬锂能	2020-12-28	2021-01-25	81.50	10,000.00	815,000.00
202012 280000 7963	300383	光环新网	2020-12-28	2021-01-25	17.17	30,000.00	515,100.00

202012 280000 7965	300122	智飞生物	2020-12-28	2021-01- 25	147.91	10,000.00	1,479,100.0 0
202012 280000 7967	300567	精测电子	2020-12-28	2021-01- 25	54.94	10,000.00	549,400.00
202012 280000 7969	300750	宁德时代	2020-12-28	2021-01- 25	351.11	10,000.00	3,511,100.0 0
202012 280000 7971	300113	顺网科技	2020-12-28	2021-01- 25	17.15	30,000.00	514,500.00
202012 280000 8277	300113	顺网科技	2020-12-28	2021-01- 25	17.15	48,000.00	823,200.00
202012 280000 8279	300760	迈瑞医疗	2020-12-28	2021-01- 25	426.00	27,000.00	11,502,000. 00
202012 280000 8287	300015	爱尔眼科	2020-12-28	2021-01- 25	74.89	12,000.00	898,680.00
202012 280000 8289	300316	晶盛机电	2020-12-28	2021-01- 25	30.08	32,000.00	962,560.00
202012 280000 8291	300014	亿纬锂能	2020-12-28	2021-01- 25	81.50	21,000.00	1,711,500.0 0
202012 280000 8293	300059	东方财富	2020-12-28	2021-01- 25	31.00	13,000.00	403,000.00
202012 280000 8295	300115	长盈精密	2020-12-28	2021-01- 25	24.65	6,000.00	147,900.00
202012 280000 8297	300433	蓝思科技	2020-12-28	2021-01- 25	30.61	50,000.00	1,530,500.0 0
202012 280000 8359	300015	爱尔眼科	2020-12-28	2021-01- 25	74.89	20,000.00	1,497,800.0 0
202012 280000 8361	300136	信维通信	2020-12-28	2021-01- 25	35.88	10,000.00	358,800.00
202012 290000	300088	长信科技	2020-12-29	2021-01- 15	8.89	46,000.00	408,940.00

0476							
202012 290000 0478	300274	阳光电源	2020-12-29	2021-01-15	72.28	1,000.00	72,280.00
202012 290000 0480	300253	卫宁健康	2020-12-29	2021-01-15	17.50	1,000.00	17,500.00
202012 290000 0482	300748	金力永磁	2020-12-29	2021-01-15	36.34	1,000.00	36,340.00
202012 290000 0484	300618	寒锐钴业	2020-12-29	2021-01-15	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 290000 0486	300003	乐普医疗	2020-12-29	2021-01-15	27.18	10,000.00	271,800.00
202012 290000 0488	300024	机器人	2020-12-29	2021-01-15	12.30	10,000.00	123,000.00
202012 290000 0490	300113	顺网科技	2020-12-29	2021-01-15	17.15	10,000.00	171,500.00
202012 290000 0492	300014	亿纬锂能	2020-12-29	2021-01-15	81.50	10,000.00	815,000.00
202012 290000 0494	300182	捷成股份	2020-12-29	2021-01-15	3.23	110,000.00	355,300.00
202012 290000 0496	300315	掌趣科技	2020-12-29	2021-01-15	5.11	11,000.00	56,210.00
202012 290000 0498	300122	智飞生物	2020-12-29	2021-01-15	147.91	10,000.00	1,479,100.00
202012 290000 0500	300014	亿纬锂能	2020-12-29	2021-01-15	81.50	14,000.00	1,141,000.00
202012 290000 0502	300088	长信科技	2020-12-29	2021-01-15	8.89	100,000.00	889,000.00
202012 290000 0504	300496	中科创达	2020-12-29	2021-01-15	117.00	20,000.00	2,340,000.00
202012	300782	卓胜微	2020-12-29	2021-01-	570.54	10,000.00	5,705,400.00

290000 0506				15			0
202012 290000 0508	300024	机器人	2020-12-29	2021-01-15	12.30	10,000.00	123,000.00
202012 290000 0510	300059	东方财富	2020-12-29	2021-01-15	31.00	264,000.00	8,184,000.00
202012 290000 0512	300017	网宿科技	2020-12-29	2021-01-15	6.89	44,000.00	303,160.00
202012 290000 0514	300750	宁德时代	2020-12-29	2021-01-15	351.11	10,000.00	3,511,100.00
202012 290000 0516	300207	欣旺达	2020-12-29	2021-01-15	30.71	16,000.00	491,360.00
202012 290000 7171	300316	晶盛机电	2020-12-29	2021-01-26	30.08	20,000.00	601,600.00
202012 290000 7173	300450	先导智能	2020-12-29	2021-01-26	83.99	35,000.00	2,939,650.00
202012 290000 7175	300408	三环集团	2020-12-29	2021-01-26	37.25	71,000.00	2,644,750.00
202012 290000 7177	300383	光环新网	2020-12-29	2021-01-26	17.17	98,000.00	1,682,660.00
202012 290000 7179	300122	智飞生物	2020-12-29	2021-01-26	147.91	29,000.00	4,289,390.00
202012 290000 7181	300124	汇川技术	2020-12-29	2021-01-26	93.30	66,000.00	6,157,800.00
202012 290000 7183	300207	欣旺达	2020-12-29	2021-01-26	30.71	54,000.00	1,658,340.00
202012 290000 7185	300748	金力永磁	2020-12-29	2021-01-26	36.34	10,000.00	363,400.00
202012 290000 7187	300347	泰格医药	2020-12-29	2021-01-26	161.61	44,000.00	7,110,840.00

202012 290000 7189	300253	卫宁健康	2020-12-29	2021-01- 26	17.50	151,000.00	2,642,500.0 0
202012 290000 7191	300223	北京君正	2020-12-29	2021-01- 26	91.49	13,000.00	1,189,370.0 0
202012 290000 7193	300115	长盈精密	2020-12-29	2021-01- 26	24.65	40,000.00	986,000.00
202012 290000 7195	300113	顺网科技	2020-12-29	2021-01- 26	17.15	10,000.00	171,500.00
202012 290000 7197	300088	长信科技	2020-12-29	2021-01- 26	8.89	174,000.00	1,546,860.0 0
202012 290000 7199	300073	当升科技	2020-12-29	2021-01- 26	64.85	18,000.00	1,167,300.0 0
202012 290000 7201	300070	碧水源	2020-12-29	2021-01- 26	7.65	125,000.00	956,250.00
202012 290000 7203	300059	东方财富	2020-12-29	2021-01- 26	31.00	470,000.00	14,570,000. 00
202012 290000 7205	300058	蓝色光标	2020-12-29	2021-01- 26	6.00	176,000.00	1,056,000.0 0
202012 290000 7207	300033	同花顺	2020-12-29	2021-01- 26	123.98	13,000.00	1,611,740.0 0
202012 290000 7223	300024	机器人	2020-12-29	2021-01- 26	12.30	83,000.00	1,020,900.0 0
202012 290000 7225	300017	网宿科技	2020-12-29	2021-01- 26	6.89	153,000.00	1,054,170.0 0
202012 290000 7227	300015	爱尔眼科	2020-12-29	2021-01- 26	74.89	99,000.00	7,414,110.0 0
202012 290000 7229	300014	亿纬锂能	2020-12-29	2021-01- 26	81.50	104,000.00	8,476,000.0 0
202012 290000	300003	乐普医疗	2020-12-29	2021-01- 26	27.18	126,000.00	3,424,680.0 0

7231							
202012 300000 0705	300070	碧水源	2020-12-30	2021-01-27	7.65	25,000.00	191,250.00
202012 300000 0707	300088	长信科技	2020-12-30	2021-01-27	8.89	25,000.00	222,250.00
202012 300000 0709	300124	汇川技术	2020-12-30	2021-01-27	93.30	10,000.00	933,000.00
202012 300000 0711	300059	东方财富	2020-12-30	2021-01-27	31.00	70,000.00	2,170,000.00
202012 300000 0713	300017	网宿科技	2020-12-30	2021-01-27	6.89	20,000.00	137,800.00
202012 300000 0715	300024	机器人	2020-12-30	2021-01-27	12.30	15,000.00	184,500.00
202012 300000 0717	300058	蓝色光标	2020-12-30	2021-01-27	6.00	20,000.00	120,000.00
202012 300000 0719	300136	信维通信	2020-12-30	2021-01-27	35.88	10,000.00	358,800.00
202012 300000 0721	300296	利亚德	2020-12-30	2021-01-27	6.36	20,000.00	127,200.00
202012 300000 0723	300315	掌趣科技	2020-12-30	2021-01-27	5.11	30,000.00	153,300.00
202012 300000 0725	300408	三环集团	2020-12-30	2021-01-27	37.25	10,000.00	372,500.00
202012 300000 0727	300207	欣旺达	2020-12-30	2021-01-27	30.71	10,000.00	307,100.00
202012 300000 0729	300142	沃森生物	2020-12-30	2021-01-27	38.56	15,000.00	578,400.00
202012 300000 0731	300146	汤臣倍健	2020-12-30	2021-01-27	24.15	10,000.00	241,500.00
202012	300166	东方国信	2020-12-30	2021-01-	10.95	10,000.00	109,500.00

300000 0733				27			
202012 300000 0735	300024	机器人	2020-12-30	2021-01- 27	12.30	10,000.00	123,000.00
202012 300000 0737	300450	先导智能	2020-12-30	2021-01- 27	83.99	50,000.00	4,199,500.0 0
202012 300000 0739	300088	长信科技	2020-12-30	2021-01- 27	8.89	60,000.00	533,400.00
202012 300000 0741	300142	沃森生物	2020-12-30	2021-01- 27	38.56	10,000.00	385,600.00
202012 300000 0743	300088	长信科技	2020-12-30	2021-01- 27	8.89	80,000.00	711,200.00
202012 300000 0745	300558	贝达药业	2020-12-30	2021-01- 27	107.37	20,000.00	2,147,400.0 0
202012 300000 0747	300024	机器人	2020-12-30	2021-01- 27	12.30	5,000.00	61,500.00
202012 300000 0749	300136	信维通信	2020-12-30	2021-01- 27	35.88	20,000.00	717,600.00
202012 300000 0751	300009	安科生物	2020-12-30	2021-01- 27	14.68	10,000.00	146,800.00
202012 300000 0753	300014	亿纬锂能	2020-12-30	2021-01- 27	81.50	10,000.00	815,000.00
202012 300000 0755	300015	爱尔眼科	2020-12-30	2021-01- 27	74.89	15,000.00	1,123,350.0 0
202012 300000 0757	300003	乐普医疗	2020-12-30	2021-01- 27	27.18	15,000.00	407,700.00
202012 300000 0759	300274	阳光电源	2020-12-30	2021-01- 27	72.28	1,000.00	72,280.00
202012 300000 0761	300315	掌趣科技	2020-12-30	2021-01- 27	5.11	50,000.00	255,500.00

202012 300000 0763	300666	江丰电子	2020-12-30	2021-01- 27	49.51	1,000.00	49,510.00
202012 300000 9103	300223	北京君正	2020-12-30	2021-01- 27	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 300000 9105	300113	顺网科技	2020-12-30	2021-01- 27	17.15	14,000.00	240,100.00
202012 300000 9107	300661	圣邦股份	2020-12-30	2021-01- 27	263.80	10,000.00	2,638,000.0 0
202012 300000 9109	300748	金力永磁	2020-12-30	2021-01- 27	36.34	1,000.00	36,340.00
202012 300000 9111	300059	东方财富	2020-12-30	2021-01- 27	31.00	310,000.00	9,610,000.0 0
202012 300000 9161	300017	网宿科技	2020-12-30	2021-01- 13	6.89	25,000.00	172,250.00
202012 300000 9163	300059	东方财富	2020-12-30	2021-01- 13	31.00	100,000.00	3,100,000.0 0
202012 300000 9165	300073	当升科技	2020-12-30	2021-01- 27	64.85	10,000.00	648,500.00
202012 300000 9167	300142	沃森生物	2020-12-30	2021-01- 13	38.56	3,000.00	115,680.00
202012 300000 9169	300450	先导智能	2020-12-30	2021-01- 27	83.99	1,000.00	83,990.00
202012 300000 9171	300316	晶盛机电	2020-12-30	2021-01- 27	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 300000 9173	300207	欣旺达	2020-12-30	2021-01- 13	30.71	2,000.00	61,420.00
202012 300000 9175	300666	江丰电子	2020-12-30	2021-01- 13	49.51	4,000.00	198,040.00
202012 300000	300316	晶盛机电	2020-12-30	2021-01- 27	30.08	20,000.00	601,600.00

9177							
202012 300000 9179	300059	东方财富	2020-12-30	2021-01- 27	31.00	80,000.00	2,480,000.0 0
202012 300000 9271	300058	蓝色光标	2020-12-30	2021-01- 27	6.00	40,000.00	240,000.00
202012 300000 9273	300070	碧水源	2020-12-30	2021-01- 27	7.65	45,000.00	344,250.00
202012 300000 9275	300315	掌趣科技	2020-12-30	2021-01- 27	5.11	120,000.00	613,200.00
202012 300000 9277	300223	北京君正	2020-12-30	2021-01- 27	91.49	1,000.00	91,490.00
202012 300000 9279	300059	东方财富	2020-12-30	2021-01- 27	31.00	450,000.00	13,950,000. 00
202012 310000 0204	300142	沃森生物	2020-12-31	2021-01- 28	38.56	10,000.00	385,600.00
202012 310000 0206	300088	长信科技	2020-12-31	2021-01- 28	8.89	80,000.00	711,200.00
202012 310000 0208	300274	阳光电源	2020-12-31	2021-01- 28	72.28	1,000.00	72,280.00
202012 310000 0210	300059	东方财富	2020-12-31	2021-01- 28	31.00	500,000.00	15,500,000. 00
202012 310000 0212	300618	寒锐钴业	2020-12-31	2021-01- 28	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 310000 0214	300253	卫宁健康	2020-12-31	2021-01- 28	17.50	63,000.00	1,102,500.0 0
202012 310000 0218	300015	爱尔眼科	2020-12-31	2021-01- 28	74.89	27,000.00	2,022,030.0 0
202012 310000 0220	300296	利亚德	2020-12-31	2021-01- 28	6.36	314,000.00	1,997,040.0 0
202012	300773	拉卡拉	2020-12-31	2021-01-	29.92	69,000.00	2,064,480.0

310000 0222				28			0
202012 310000 0224	300618	寒锐钴业	2020-12-31	2021-01-28	94.91	1,000.00	94,910.00
202012 310000 9490	300058	蓝色光标	2020-12-31	2021-01-28	6.00	110,000.00	660,000.00
202012 310000 9492	300315	掌趣科技	2020-12-31	2021-01-28	5.11	50,000.00	255,500.00
202012 310000 9494	300251	光线传媒	2020-12-31	2021-01-28	12.07	100,000.00	1,207,000.00
202012 310000 9496	300059	东方财富	2020-12-31	2021-01-28	31.00	40,000.00	1,240,000.00
202012 310000 9498	300058	蓝色光标	2020-12-31	2021-01-28	6.00	80,000.00	480,000.00
202012 310000 9500	300315	掌趣科技	2020-12-31	2021-01-28	5.11	200,000.00	1,022,000.00
202012 310000 9502	300223	北京君正	2020-12-31	2021-01-28	91.49	10,000.00	914,900.00
202012 310000 9504	300115	长盈精密	2020-12-31	2021-01-28	24.65	40,000.00	986,000.00
202012 310000 9506	300347	泰格医药	2020-12-31	2021-01-28	161.61	11,000.00	1,777,710.00
202012 310000 9508	300059	东方财富	2020-12-31	2021-01-28	31.00	120,000.00	3,720,000.00
202012 310000 9510	300661	圣邦股份	2020-12-31	2021-01-28	263.80	5,000.00	1,319,000.00
202012 310000 9512	300316	晶盛机电	2020-12-31	2021-01-28	30.08	20,000.00	601,600.00
202012 310000 9514	300315	掌趣科技	2020-12-31	2021-01-28	5.11	150,000.00	766,500.00

202012 310000 9516	300014	亿纬锂能	2020-12-31	2021-01-28	81.50	10,000.00	815,000.00
202012 310000 9518	300661	圣邦股份	2020-12-31	2021-01-28	263.80	2,000.00	527,600.00
202012 310000 9520	300017	网宿科技	2020-12-31	2021-01-28	6.89	100,000.00	689,000.00
202012 310000 9522	300017	网宿科技	2020-12-31	2021-01-28	6.89	30,000.00	206,700.00
202012 310000 9524	300017	网宿科技	2020-12-31	2021-01-28	6.89	100,000.00	689,000.00
202012 310000 9526	300058	蓝色光标	2020-12-31	2021-01-28	6.00	30,000.00	180,000.00
202012 310000 9528	300115	长盈精密	2020-12-31	2021-01-28	24.65	30,000.00	739,500.00
202012 310000 9530	300113	顺网科技	2020-12-31	2021-01-28	17.15	50,000.00	857,500.00
202012 310000 9532	300567	精测电子	2020-12-31	2021-01-28	54.94	38,000.00	2,087,720.00
202012 310000 9534	300142	沃森生物	2020-12-31	2021-01-28	38.56	10,000.00	385,600.00
202012 310000 9998	300113	顺网科技	2020-12-31	2021-01-28	17.15	15,000.00	257,250.00
202012 310001 0000	300166	东方国信	2020-12-31	2021-01-28	10.95	12,000.00	131,400.00
202012 310001 0002	300496	中科创达	2020-12-31	2021-01-28	117.00	11,000.00	1,287,000.00
202012 310001 0004	300088	长信科技	2020-12-31	2021-01-28	8.89	30,000.00	266,700.00
202012 310001	300070	碧水源	2020-12-31	2021-01-28	7.65	68,000.00	520,200.00

0006							
202012 310001 0008	300316	晶盛机电	2020-12-31	2021-01-28	30.08	10,000.00	300,800.00
202012 310001 0010	300253	卫宁健康	2020-12-31	2021-01-28	17.50	73,000.00	1,277,500.00
202012 310001 0012	300059	东方财富	2020-12-31	2021-01-28	31.00	20,000.00	620,000.00
202012 310001 0014	300058	蓝色光标	2020-12-31	2021-01-28	6.00	83,000.00	498,000.00
202012 310001 0016	300017	网宿科技	2020-12-31	2021-01-28	6.89	77,000.00	530,530.00
合计	—	—	—	—	—	—	1,223,245,390.00

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司总经理

负责，并由督察长分管。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2019 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.30%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 10,472,855,065.93 元，超过经确认的当日净赎回金额。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	30,078,837.99	-	-	-	30,078,837.99
结算备付金	1,385,678.01	-	-	-	1,385,678.01
存出保证金	197,809.14	-	-	-	197,809.14
交易性金融资产	-	-	-	10,470,128,316.11	10,470,128,316.11
应收证券清算款	-	-	-	4,229,384.46	4,229,384.46
应收利息	-	-	-	1,267,913.66	1,267,913.66
资产总计	31,662,325.14	-	-	10,475,625,614.23	10,507,287,939.37
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	260,706.73	260,706.73
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,546,895.41	4,546,895.41
应付托管费	-	-	-	909,379.12	909,379.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,900,008.68	2,900,008.68
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,476,545.26	1,476,545.26
负债总计	-	-	-	10,093,535.20	10,093,535.20
利率敏感度缺口	31,662,325.14	-	-	10,465,532,079.03	10,497,194,404.17
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	27,891,783.76	-	-	-	27,891,783.76
结算备付金	386,561.73	-	-	-	386,561.73
存出保证金	42,813.21	-	-	-	42,813.21
交易性金融资产	-	-	-	5,487,973,164.37	5,487,973,164.37
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	131,645.53	131,645.53
其他资产	-	-	-	112,121.73	112,121.73
资产总计	28,321,158.70	-	-	5,488,216,931.63	5,516,538,090.33
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,004,220.42	1,004,220.42
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,316,872.86	2,316,872.86
应付托管费	-	-	-	463,374.59	463,374.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,343,353.32	1,343,353.32
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	815,382.44	815,382.44
负债总计	-	-	-	5,943,203.63	5,943,203.63
利率敏感度缺口	28,321,158.70	-	-	5,482,273,728.00	5,510,594,886.70

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2019 年 12 月 31 日：同)，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 90%，投资于创业板 50 指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例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、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	10,470,128,316.11	99.74	5,487,973,164.37	99.59
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	10,470,128,316.11	99.74	5,487,973,164.37	99.59

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 522,730,000.00	增加约 274,000,000.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 522,730,000.00	减少约 274,000,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2020 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 74,788,336,815.35 元(2019 年度：30,711,317,238.81 元)，其中包括以股票支付的申购款 74,396,189,845.86 元和以现金支付的申购款 392,146,969.49 元(2019 年度：其中包括以股票支付的申购款 31,282,071,936.14 元和以现金支付的申购款-570,754,697.33 元)。

(2) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 10,439,148,079.00 元，属于第二层次的余额为 30,980,237.11 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 5,487,973,164.37 元，无第二或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(3) 除基金申购款和公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	10,470,128,316.11	99.65
	其中：股票	10,470,128,316.11	99.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	31,464,516.00	0.30
8	其他各项资产	5,695,107.26	0.05

9	合计	10,507,287,939.37	100.00
---	----	-------------------	--------

注：此处股票投资含可退替代款估值增值 2,940.00 元。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,143,349,213.87	68.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	694,695,871.24	6.62
J	金融业	1,083,497,091.00	10.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	56,812,404.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	108,817,812.16	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	72,726,568.65	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	994,704,418.86	9.48
R	文化、体育和娱乐业	314,527,783.14	3.00
S	综合	-	-
	合计	10,469,131,162.92	99.73

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	849,489.02	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	77,672.27	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	15,081.10	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	994,213.19	0.01

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	4,735,448	1,662,663,147.28	15.84
2	300059	东方财富	31,102,340	964,172,540.00	9.19
3	300760	迈瑞医疗	1,932,251	823,138,926.00	7.84
4	300015	爱尔眼科	8,141,517	609,718,208.13	5.81
5	300124	汇川技术	5,172,972	482,638,287.60	4.60
6	300122	智飞生物	2,863,929	423,603,738.39	4.04
7	300014	亿纬锂能	5,096,493	415,364,179.50	3.96
8	300347	泰格医药	2,382,193	384,986,210.73	3.67
9	300274	阳光电源	4,415,366	319,142,654.48	3.04
10	300142	沃森生物	7,258,595	279,891,423.20	2.67
11	300782	卓胜微	456,328	260,353,377.12	2.48
12	300601	康泰生物	1,372,115	239,434,067.50	2.28
13	300450	先导智能	2,772,988	232,903,262.12	2.22
14	300413	芒果超媒	3,110,822	225,534,595.00	2.15
15	300433	蓝思科技	6,277,100	192,142,031.00	1.83
16	300408	三环集团	4,878,253	181,714,924.25	1.73
17	300677	英科医疗	966,002	162,433,236.30	1.55
18	300496	中科创达	1,267,176	148,259,592.00	1.41
19	300003	乐普医疗	5,427,986	147,532,659.48	1.41
20	300207	欣旺达	4,591,343	141,000,143.53	1.34
21	300253	卫宁健康	7,932,067	138,811,172.50	1.32
22	300136	信维通信	3,758,249	134,845,974.12	1.28
23	300033	同花顺	962,450	119,324,551.00	1.14
24	300558	贝达药业	1,099,800	118,085,526.00	1.12
25	300661	圣邦股份	419,927	110,776,742.60	1.06
26	300676	华大基因	846,436	108,817,812.16	1.04
27	300073	当升科技	1,651,304	107,087,064.40	1.02
28	300383	光环新网	5,095,727	87,493,632.59	0.83
29	300146	汤臣倍健	3,512,085	84,816,852.75	0.81
30	300088	长信科技	9,515,656	84,594,181.84	0.81
31	300316	晶盛机电	2,786,587	83,820,536.96	0.80
32	300070	碧水源	9,506,741	72,726,568.65	0.69
33	300618	寒锐钴业	720,115	68,346,114.65	0.65
34	300024	机器人	5,457,118	67,122,551.40	0.64
35	300418	昆仑万维	3,257,930	64,995,703.50	0.62
36	300115	长盈精密	2,631,943	64,877,394.95	0.62
37	300017	网宿科技	9,225,351	63,562,668.39	0.61
38	300009	安科生物	4,159,200	61,057,056.00	0.58
39	300315	掌趣科技	11,751,356	60,049,429.16	0.57
40	300251	光线传媒	4,883,902	58,948,697.14	0.56
41	300058	蓝色光标	9,468,734	56,812,404.00	0.54

42	300773	拉卡拉	1,888,100	56,491,952.00	0.54
43	300296	利亚德	8,737,176	55,568,439.36	0.53
44	300223	北京君正	538,207	49,240,558.43	0.47
45	300166	东方国信	3,646,440	39,928,518.00	0.38
46	300567	精测电子	700,700	38,496,458.00	0.37
47	300113	顺网科技	2,046,834	35,103,203.10	0.33
48	300182	捷成股份	9,301,700	30,044,491.00	0.29
49	300748	金力永磁	748,818	27,212,046.12	0.26
50	300666	江丰电子	473,554	23,445,658.54	0.22

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300896	爱美客	473.00	285,389.28	0.00
2	300869	康泰医学	862.00	95,578.56	0.00
3	300926	博俊科技	3,584.00	38,563.84	0.00
4	300872	天阳科技	871.00	32,958.64	0.00
5	300900	广联航空	879.00	29,147.64	0.00
6	300927	江天化学	2,163.00	28,962.57	0.00
7	300877	金春股份	569.00	28,933.65	0.00
8	300868	杰美特	593.00	25,665.04	0.00
9	300871	回盛生物	618.00	23,916.60	0.00
10	300894	火星人	628.00	23,217.16	0.00
11	300910	瑞丰新材	474.00	22,690.38	0.00
12	003026	中晶科技	461.00	21,740.76	0.00
13	300873	海晨股份	484.00	19,998.88	0.00
14	300878	维康药业	401.00	19,536.72	0.00
15	300891	惠云钛业	1,143.00	18,745.20	0.00
16	003029	吉大正元	716.00	18,716.24	0.00
17	003028	振邦智能	432.00	18,010.08	0.00
18	300908	仲景食品	285.00	17,225.40	0.00
19	300884	狄耐克	499.00	16,721.49	0.00
20	300898	熊猫乳品	496.00	16,382.88	0.00
21	300892	品渥食品	272.00	16,322.72	0.00
22	300887	谱尼测试	210.00	15,649.20	0.00
23	300913	兆龙互连	630.00	15,082.20	0.00
24	300864	南大环境	166.00	15,081.10	0.00
25	300889	爱克股份	479.00	14,427.48	0.00
26	300902	国安达	551.00	13,367.26	0.00
27	300925	法本信息	353.00	13,177.49	0.00
28	300895	铜牛信息	283.00	12,819.90	0.00
29	300907	康平科技	473.00	12,700.05	0.00

30	300879	大叶股份	466.00	12,637.92	0.00
31	300893	松原股份	276.00	9,682.08	0.00
32	300918	南山智尚	1,063.00	9,503.22	0.00
33	300881	盛德鑫泰	291.00	9,402.21	0.00
34	300922	天秦装备	287.00	9,063.46	0.00
35	003030	祖名股份	480.00	7,286.40	0.00
36	003031	中瓷电子	387.00	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	328,397,093.50	5.96
2	300782	卓胜微	226,904,773.23	4.12
3	300661	圣邦股份	212,492,231.86	3.86
4	300677	英科医疗	155,120,945.99	2.81
5	300059	东方财富	133,392,356.53	2.42
6	300558	贝达药业	119,268,941.23	2.16
7	300760	迈瑞医疗	114,088,007.82	2.07
8	300122	智飞生物	100,511,630.29	1.82
9	300014	亿纬锂能	93,376,383.10	1.69
10	300058	蓝色光标	93,009,239.20	1.69
11	300773	拉卡拉	78,272,356.08	1.42
12	300142	沃森生物	76,297,188.34	1.38
13	300009	安科生物	72,805,588.22	1.32
14	300296	利亚德	70,490,122.01	1.28
15	300223	北京君正	69,895,494.94	1.27
16	300433	蓝思科技	66,267,536.53	1.20
17	300166	东方国信	59,428,487.58	1.08
18	300496	中科创达	43,371,813.57	0.79
19	300601	康泰生物	33,182,904.51	0.60
20	300253	卫宁健康	31,499,124.41	0.57

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300782	卓胜微	244,058,579.83	4.43
2	300760	迈瑞医疗	155,835,231.25	2.83
3	300059	东方财富	127,509,973.62	2.31
4	300014	亿纬锂能	105,329,390.08	1.91
5	300168	万达信息	102,718,757.28	1.86
6	300661	圣邦股份	87,108,376.91	1.58
7	300308	中际旭创	84,593,418.86	1.54
8	300750	宁德时代	84,561,224.47	1.53
9	300212	易华录	75,247,150.83	1.37
10	300015	爱尔眼科	73,649,914.43	1.34
11	300124	汇川技术	62,692,716.43	1.14
12	300347	泰格医药	60,687,687.43	1.10
13	300033	同花顺	42,198,749.48	0.77
14	300136	信维通信	41,537,137.47	0.75
15	300098	高新兴	38,952,583.85	0.71
16	300003	乐普医疗	36,798,590.66	0.67
17	300078	思创医惠	35,161,428.28	0.64
18	300068	南都电源	34,296,446.63	0.62
19	300170	汉得信息	34,122,479.46	0.62
20	300408	三环集团	32,293,796.26	0.59

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,760,453,215.91
卖出股票的收入（成交）总额	2,130,759,321.36

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	197,809.14
2	应收证券清算款	4,229,384.46
3	应收股利	-
4	应收利息	1,267,913.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,695,107.26

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	154,137,290.00	1.47	转融通证券出借
2	300059	东方财富	121,861,000.00	1.16	转融通证券出借
3	300122	智飞生物	76,617,380.00	0.73	转融通证券出借
4	300014	亿纬锂能	75,143,000.00	0.72	转融通证券出借
5	300274	阳光电源	60,498,360.00	0.58	转融通证券出借
6	300760	迈瑞医疗	53,250,000.00	0.51	转融通证券出借
7	300142	沃森生物	51,246,240.00	0.49	转融通证券出借
8	300015	爱尔眼科	42,911,970.00	0.41	转融通证券出借
9	300347	泰格医药	25,534,380.00	0.24	转融通证券出借
10	300124	汇川技术	25,004,400.00	0.24	转融通证券出借

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300896	爱美客	285,389.28	0.00	处于锁定期
2	300869	康泰医学	95,578.56	0.00	处于锁定期
3	300926	博俊科技	38,563.84	0.00	网下中签未上市
4	300872	天阳科技	32,958.64	0.00	处于锁定期
5	300900	广联航空	29,147.64	0.00	处于锁定期

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
120,660	69,781.08	3,272,200,795.00	38.86%	5,147,584,318.00	61.14%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	创金合信基金—华夏银行—创金合信华睿2号集合资产管理计划	240,071,858.00	2.85%
2	华夏基金—华夏银行—华夏银行股份有限公司	231,800,000.00	2.75%
3	申万宏源证券有限公司	187,022,900.00	2.22%
4	中国人保资产管理股份有限公司—安心收益投资产品	107,005,600.00	1.27%
5	中国人寿保险股份有限公司	93,260,400.00	1.11%
6	中信证券股份有限公司	92,174,936.00	1.09%
7	平安基金—中国平安财产保险股份有限公司（传统普通保险产品）—平安产	70,000,000.00	0.83%

	险一平安基金委托投资 1 号权益单一资产管理计划		
8	俞枝枝	60,254,500.00	0.72%
9	人保资管一民生银行一人保资产安心收益 2 号资产管理产品	54,132,100.00	0.64%
10	华夏人寿保险股份有限公司一万能保险产品	40,640,100.00	0.48%
11	中国建设银行股份有限公司一华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,277,756,832.00	15.18%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016 年 6 月 30 日)基金份额总额	550,285,113.00
本报告期期初基金份额总额	8,342,785,113.00
本报告期基金总申购份额	79,500,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	79,423,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,419,785,113.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2020 年 8 月 15 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，童威先生离任本基金管理人的总经理。

(2) 2020 年 8 月 22 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，薛珍女士离任本基金管理人的督察长。

(3) 2020 年 10 月 17 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告》，张霄岭先生新任本基金管理人的总经理。

(4) 2020 年 12 月 18 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告》，范伟隽先生新任本基金管理人的首席信息官。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

11.3 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财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

11.6 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为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 155,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
中信证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券(华 南)	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	4,885,527,050.08	100.00%	4,452,188.92	100.00%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

（1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

11.8.2 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		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
中信证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	51,927,176.65	100.00%	-	-	-	-

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-01-28
2	华安基金管理有限公司关于公司自有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告.doc	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-02-04
3	华安基金管理有限公司关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-04

4	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同（更新）.doc	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
5	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议（更新）.doc	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
6	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(2020 年第 1 号).doc	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
7	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要(2020 年第 1 号).doc	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
8	华安基金管理有限公司关于根据信息披露管理办法修订旗下公募基金基金合同等法律文件的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-07
9	华安基金管理有限公司关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-09
10	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台调整“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-14
11	华安基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-25
12	华安基金关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-03-30
13	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-04-11
14	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-04-22
15	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-06-29
16	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-06-29
17	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-07-21
18	华安基金管理有限公司关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2020-07-21

	商的公告.docx	定媒介	
19	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-15
20	华安基金管理有限公司关于督察长变更的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-22
21	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-28
22	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-08-31
23	华安基金管理有限公司关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金新增一级交易商的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-03
24	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告(天元股份).doc	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-12
25	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-28
26	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-09-28
27	华安基金管理有限公司关于总经理变更的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-17
28	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-10-27
29	华安基金管理有限公司关于旗下所有前端收费模式基金在直销柜台实施费率优惠的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-18
30	华安基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-18
31	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同(更新).doc	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-19
32	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议(更新).doc	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-19
33	华安基金管理有限公司关于修订旗下部分公	中国证监会基金电子披	2020-12-19

	募基金基金合同的公告.docx	露网站和公司网站等指定媒介	
34	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-23
35	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(2020 年第 2 号).doc	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-23
36	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-28
37	关于基金电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告.docx	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2020-12-28

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20200101-20201231	356,984,332.00	2,033,000,000.00	1,112,227,500.00	1,277,756,832.00	15.18%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；

- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇二一年三月三十日