

# 汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证 券投资基金（LOF）2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现 .....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§ 4 管理人报告 .....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	24
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	24
§ 5 托管人报告 .....	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	24
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	24
§ 6 审计报告 .....	25
6.1 审计报告的基本信息.....	25
6.2 审计报告的基本内容.....	25
§ 7 年度财务报表.....	27
7.1 资产负债表 .....	27
7.2 利润表 .....	28
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	29
7.4 报表附注 .....	31
§ 8 投资组合报告.....	156
8.1 期末基金资产组合情况.....	156
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	157
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	158

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	164
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	165
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.....	165
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.....	165
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.....	166
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.....	166
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	166
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	166
8.12 投资组合报告附注.....	166
§ 9 基金份额持有人信息.....	167
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	167
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	168
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	169
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	169
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	170
§ 10 开放式基金份额变动.....	170
§ 11 重大事件揭示.....	170
11.1 基金份额持有人大会决议.....	171
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.....	171
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	171
11.4 基金投资策略的改变.....	171
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	171
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	171
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	172
11.8 其他重大事件.....	176
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	177
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	177
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	177
§ 13 备查文件目录.....	177
13.1 备查文件目录.....	177
13.2 存放地点.....	177
13.3 查阅方式.....	178

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）	
基金简称	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）	
基金主代码	501057	
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2018年05月23日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	6,112,953,338.18	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2018年06月20日	
下属分级基金的基金简称	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C
下属分级基金场内简称	新能源车	新能车 C
下属分级基金的交易代码	501057	501058
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	3,446,055,877.35	2,666,897,460.83

注：A类份额扩位证券简称：新能源车 LOF；C类份额扩位证券简称：新能源车 LOFC。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照标的指数的成份股及其权重来构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。本基金的投资策略主要包括：股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。

业绩比较基准	中证新能源汽车产业指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇添富基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏
	联系电话	021-28932888
	电子邮箱	service@99fund.com
客户服务电话	400-888-9918	95588
传真	021-28932998	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市黄浦区外马路728号	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200010	100140
法定代表人	李文	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1 .1 期间 数据 和 指标	2022 年		2021 年		2020 年	
	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) A	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) C	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) A	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) C	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) A	汇添富中证 新能源汽车 产业指数 (LOF) C
本期 已 实 现 收 益	- 166,466,34 4.76	- 145,091,67 0.49	1,561,840, 841.38	1,063,769, 167.66	230,368,26 5.49	156,869,57 4.71
本期 利 润	- 2,917,924, 492.01	- 2,076,802, 102.19	1,921,443, 898.11	1,509,993, 583.04	1,080,946, 359.16	728,737,41 4.60
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	-0.8454	-0.8462	0.7457	0.8410	1.2060	1.1687
本 期 加 权 平 均 净	-32.37%	-32.88%	27.02%	30.82%	87.04%	84.49%

值 利 润 率						
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	-27.37%	-27.55%	42.98%	42.62%	107.25%	106.74%
3.1 .2 期 末 数 据 和 指 标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	2,241,697, 368.75	1,663,368, 821.72	2,443,126, 497.77	1,583,751, 888.55	175,198,85 4.62	111,642,91 7.47
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	0.6505	0.6237	0.6993	0.6784	0.1076	0.0986



期末基金资产净值	7,647,210,211.16	5,843,741,104.71	10,674,325,357.33	7,061,384,815.91	3,480,525,503.92	2,401,100,290.62
期末基金份额净值	2.2191	2.1912	3.0555	3.0246	2.1370	2.1207
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	121.91%	119.12%	205.55%	202.46%	113.70%	112.07%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.62%	1.87%	-5.37%	1.87%	-0.25%	0.00%
过去六个月	-27.44%	1.88%	-27.24%	1.88%	-0.20%	0.00%
过去一年	-27.37%	2.20%	-27.34%	2.20%	-0.03%	0.00%
过去三年	115.22%	2.31%	109.94%	2.33%	5.28%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	121.91%	2.04%	72.10%	2.09%	49.81%	-0.05%
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.68%	1.87%	-5.37%	1.87%	-0.31%	0.00%
过去六个月	-27.53%	1.88%	-27.24%	1.88%	-0.29%	0.00%
过去一年	-27.55%	2.20%	-27.34%	2.20%	-0.21%	0.00%
过去三年	113.61%	2.31%	109.94%	2.33%	3.67%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	119.12%	2.04%	72.10%	2.09%	47.02%	-0.05%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较

## 基准收益率变动的比较

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



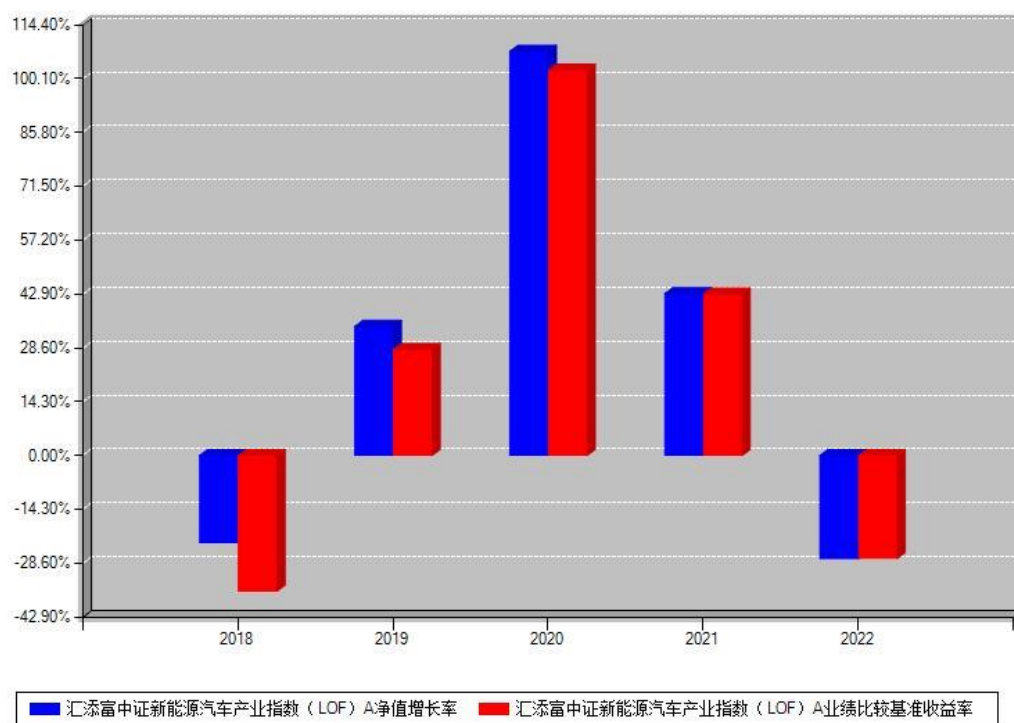
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



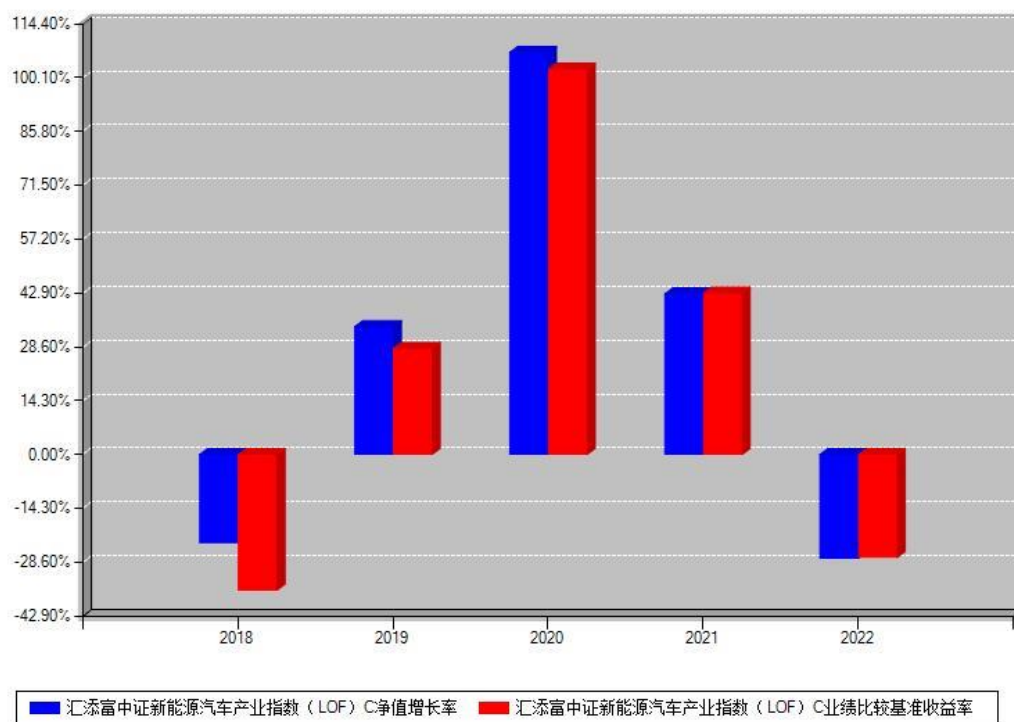
注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2018年05月23日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 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

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C 每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2018 年 05 月 23 日，合同生效当年按实际存续期计算，不

按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

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

效，实现了平台活跃度的大幅提升，力争形成长期增长的良性循环。对外合作上，进一步加深与多家互联网巨头的深度战略合作，继续大力开拓新型互联网销售及服务模式，实现与平台的合作共赢。

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

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

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

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

2022 年以来，汇添富以爱能改变为任，积极投身公益慈善，履行社会责任。公司积极支持上海疫情防控，支援街道、社区、医院和学校防疫工作；继续为推动中西部欠发达地区教

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
过蓓蓓	本基金的基金经理，指数与量化投资部总监助理	2018 年 05 月 23 日		11	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部

				<p>助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部总监助理。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 3 日至今任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 3 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券</p>
--	--	--	--	---



				<p>投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2018 年 10 月 23 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生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 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行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 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021</p>
--	--	--	--	---

				<p>年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任</p>
--	--	--	--	---

					汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。（2）在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经

理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。另外，公司还建立机制要求公募投资组合经理与资产管理计划投资组合经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。（3）在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。（4）在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年市场波动较大，季度震荡较为剧烈，宽基指数下跌幅度较大，行业指数普遍调整，仅能源行业收红。市场大幅波动主要是由于内外部因素的共同影响。国内在上半年经历了区域生产开工不足，产业链供应收紧，消费场景受压制等因素的影响，压制了市场风险偏好，下半年是内部环境逐渐修复的过程，但大部分行业基本面的修复仍然较慢。外部因素主要来自于海外高通胀环境，海外无风险利率的快速抬升，给汇率造成压力，进而影响了全球配置型资金对非美资产、成长板块的规避。全年的波动有行业轮动的特征，但自 10 月开始的市场反弹更多是整体层面的原因，来自于海外加息节奏的放缓、国内利率上行对内外利差的修复、国内生活及生产场景修复预期，极度悲观情绪的修复下，北向资金也开始重新流入 A 股资产。

国内通胀水平稳定，也给了国内较好的流动性和利率水平的空间，内外经济周期的时差效应，使得稳增长政策可以继续出台。但 11 月以来，收益率曲线扁平、长端利率上行，也说明市场对经济复苏有所预期，对货币政策在 2023 年逐步退出宽松有所预期。

新能源汽车是高成长板块中市场关注较高的子板块。2022 年全国新能源汽车销售数据不断超出市场预期，自主品牌、新势力新车型加速投放，新能源乘用车渗透率持续攀升，平均渗透率超 25%，单月接近 40%。新能源汽车板块 7 月份之后处于下跌回调的过程中，2022 年末指数点位接近 4 月份水平。新能源汽车板块的调整和全球经济衰退预期有较大的相关性，市场担心汽车消费能力降低，产品端最终会进入价格竞争，加之供给车型快速增多，也给汽车消费景气度造成不确定性。这是新能源车板块 2022 年回调的主要原因。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，保持了指数基金的本质属性。股票投资仓位报告期内保持在 90%~95% 之间，以实现业绩比较基准的跟踪。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A 类份额净值增长率为-27.37%，同期

业绩比较基准收益率为-27.34%。本报告期汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C类份额净值增长率为-27.55%，同期业绩比较基准收益率为-27.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年，我们需要关注海外通胀的持续性、国内通胀在经济复苏下的变动、国内经济复苏的程度。这些因素将决定我们面临的内外部流动性环境的松、紧，以及证券资产基本面的良、莠。一个情景是，海外通胀无法退到政策目标范围内而经济衰退已经出现，为了继续压低通胀，海外无风险利率有可能持续维持高位，造成国内利率空间的压缩，国内利率水平的抬升将不利于成长股的反弹、经济的复苏。另一个情景是，海外通胀回到政策目标范围内，那么无风险利率水平或将早于市场预期开始下调，对国内流动性环境将是较好的。第一个情景更大概率上是2022年预期的延续，而即便利差及汇率端在2023年依然有压力，这个压力也将明显好于2022年。因此，总的来说，2023年全球市场环境对A股投资预期是友好的。

新能源车产业在2023年有机遇也有危机。危机来自于国补退出后整车价格竞争对于尚未盈利的车企带来压力，造车势力的优胜劣汰会从2023年开始显现。机遇在于，消费者在车企的价格竞争中或许能享受到性价比更好的产品和服务，新能源车的销量或许会超出市场预期增长。产业链本身还会受益于海外电动化、能源清洁化，“出海”将是产业链从上到下的关键词，拓展更大的市场空间。因此，当新能源汽车板块估值在合理位置时，它依然将具备投资空间，通过新能源车LOF，抓住新能源车产业竞争优势崛起，中国制造走向全球并引领全球发展的机遇。

作为被动投资的指数基金，本基金在投资运作上严格遵守基金合同，坚持既定的投资策略，积极采取有效方法控制基金相对业绩比较基准的跟踪误差，实现投资目标。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

##### 1、持续提升合规法务管理

公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的公司价值观，完善合规管理体系，提升专业能力，优化合规资源配置，不断提升合规管理工作的有效性。公司坚持广泛开展合规培训、强化从业人员合规意识，不断夯实公司合规文化体系基础；持续完善公司制度流程体系、优化合规管理制度机制，通过统一的合规审核标准、动态调整的合规管理指引，有效把控各类业务的合规关键点，防范潜在风险，保障各项业务规范开展；深入细致开展合规审查工作，为各部门提供有效的合规咨询与法务支持，督促强化一线合规执行效果；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；优化从业人员管

理机制,加强管理措施,严格执行合规考核问责机制,引导全体员工不断提升合规执业意识,强化公司合规履职保障。

## 2、完善投资合规风险控制工作

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

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

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

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

## 3、加强稽核内审工作

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

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

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值,并保持估值政策和程序的一贯性。

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

权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配；若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的本基金2022年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。



## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 60466941_B108 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。</p> <p>其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现

<p>报表的责任</p>	<p>公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>许培菁   韩云</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层</p>

审计报告日期	2023年03月31日
--------	-------------

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	752,651,855.76	942,879,323.14
结算备付金		3,316,875.68	15,576,085.07
存出保证金		742,696.12	2,984,497.17
交易性金融资产	7.4.7.2	12,756,678,122.47	16,740,496,662.33
其中：股票投资		12,756,678,122.47	16,740,496,662.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	3,756,806.76
应收股利		-	-
应收申购款		18,817,414.10	99,224,057.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	320,025.83	203,369.25
资产总计		13,532,526,989.96	17,805,120,801.40
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		38.40	-
应付赎回款		24,073,021.20	43,748,005.62
应付管理人报酬		11,988,225.91	14,842,898.71
应付托管费		1,198,822.57	1,484,289.87
应付销售服务费		1,290,867.07	1,464,221.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30,357.14	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	2,994,341.80	7,871,212.77
负债合计		41,575,674.09	69,410,628.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	6,112,953,338.18	5,828,103,270.14
未分配利润	7.4.7.9	7,377,997,977.69	11,907,606,903.10
净资产合计		13,490,951,315.87	17,735,710,173.24
负债和净资产总计		13,532,526,989.96	17,805,120,801.40

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 6,112,953,338.18 份。本基金下属 A 类基金份额净值 2.2191 元，基金份额总额 3,446,055,877.35 份；本基金下属 C 类基金份额净值 2.1912 元，基金份额总额 2,666,897,460.83 份。

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

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-4,807,429,073.92</b>	<b>3,619,128,515.36</b>
1. 利息收入		11,613,347.27	8,258,539.25
其中：存款利息收入	7.4.7.10	3,153,618.96	2,671,371.43
债券利息收入		-	15,168.29
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		8,459,728.31	5,571,999.53
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-168,057,068.30	2,706,193,360.02
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-237,089,380.34	2,672,695,930.35
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	17,785,190.32	5,165,212.99
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	51,247,121.72	28,332,216.68
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-4,683,168,578.95	805,827,472.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	32,183,226.06	98,849,143.98
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>187,297,520.28</b>	<b>187,691,034.21</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	152,945,219.73	119,275,945.91
2. 托管费	7.4.10.2.2	15,294,521.99	11,927,594.55
3. 销售服务费		15,746,646.52	12,167,314.12
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		30,507.23	12.85
8. 其他费用	7.4.7.21	3,280,624.81	44,320,166.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-4,994,726,594.20</b>	<b>3,431,437,481.15</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-4,994,726,594.20</b>	<b>3,431,437,481.15</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-4,994,726,594.20</b>	<b>3,431,437,481.15</b>

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

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）

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

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	5,828,103,270.14	11,907,606,903.10	17,735,710,173.24
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	5,828,103,270.14	11,907,606,903.10	17,735,710,173.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	284,850,068.04	-4,529,608,925.41	-4,244,758,857.37
（一）、综合收益总额	-	-4,994,726,594.20	-4,994,726,594.20
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	284,850,068.04	465,117,668.79	749,967,736.83
其中：1. 基金申购款	6,536,754,235.15	10,828,126,091.54	17,364,880,326.69
2. 基金赎回款	-6,251,904,167.11	-10,363,008,422.75	-16,614,912,589.86
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	6,112,953,338.18	7,377,997,977.69	13,490,951,315.87
项目	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,760,879,098.08	3,120,746,696.46	5,881,625,794.54
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,760,879,098.08	3,120,746,696.46	5,881,625,794.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,067,224,172.06	8,786,860,206.64	11,854,084,378.70

“-”号填列)			
(一)、综合收益总额	-	3,431,437,481.15	3,431,437,481.15
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	3,067,224,172.06	5,355,422,725.49	8,422,646,897.55
其中: 1. 基金申购款	15,677,160,072.41	27,096,282,044.03	42,773,442,116.44
2. 基金赎回款	-12,609,935,900.35	-21,740,859,318.54	-34,350,795,218.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	5,828,103,270.14	11,907,606,903.10	17,735,710,173.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]2076号文《关于准予汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于2018年5月23日生效。首次设立基金募集规模为742,196,052.24份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2018）验字第60466941\_B26号验资报告予以验证。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债）、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款等）、货币市场工具、金融衍生工具（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金的股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金类资产范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：中证新能源汽车产业指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计



#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

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

##### （2）金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后

未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

(3) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

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

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

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

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

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

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

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 942,879,323.14 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 91,989.15 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 942,971,312.29 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

15,576,085.07 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 7,009.20 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 15,583,094.27 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,984,497.17 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,343.10 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,985,840.27 元。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 103,027.80 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 103,027.80 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 203,369.25 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 91,989.15 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 7,009.20 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 1,343.10 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 103,027.80 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

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

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

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

## 2. 增值税

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

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

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

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

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

## 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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



农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 4. 企业所得税

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

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

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

#### 5. 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	752,651,855.76	942,879,323.14
等于：本金	752,565,373.05	942,879,323.14
加：应计利息	86,482.71	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	752,651,855.76	942,879,323.14

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,208,988,368.47	-	12,756,678,122.47	2,452,310,246.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,208,988,368.47	-	12,756,678,122.47	2,452,310,246.00
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	14,509,638,329 .38	-	16,740,496,662.33	2,230,858,332 .95
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	14,509,638,329 .38	-	16,740,496,662.33	2,230,858,332 .95

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	203,369.25
其他应收款	320,025.83	-
待摊费用	-	-
合计	320,025.83	203,369.25

## 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,981.21	22,727.49
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,055,851.63	6,813,577.33
其中：交易所市场	2,055,851.63	6,813,577.33
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	100,000.00	80,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	713,508.96	834,907.95
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-
应付持有人大会费-律师费	-	-
其他	-	-
合计	2,994,341.80	7,871,212.77

## 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A		
项目	本期2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,493,479,146.75	3,493,479,146.75
本期申购	3,053,253,646.16	3,053,253,646.16
本期赎回（以“-”号填列）	-3,100,676,915.56	-3,100,676,915.56
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,446,055,877.35	3,446,055,877.35
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C		

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,334,624,123.39	2,334,624,123.39
本期申购	3,483,500,588.99	3,483,500,588.99
本期赎回（以“-”号填列）	-3,151,227,251.55	-3,151,227,251.55
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,666,897,460.83	2,666,897,460.83

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,443,126,497.77	4,737,719,712.81	7,180,846,210.58
本期利润	-166,466,344.76	-2,751,458,147.25	-2,917,924,492.01
本期基金份额交易产生的变动数	-34,962,784.26	-26,804,600.50	-61,767,384.76
其中：基金申购款	2,122,951,856.46	3,032,552,679.24	5,155,504,535.70
基金赎回款	-2,157,914,640.72	-3,059,357,279.74	-5,217,271,920.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,241,697,368.75	1,959,456,965.06	4,201,154,333.81
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,583,751,888.55	3,143,008,803.97	4,726,760,692.52
本期利润	-145,091,670.49	-1,931,710,431.70	-2,076,802,102.19
本期基金份额交易产生的变动数	224,708,603.66	302,176,449.89	526,885,053.55

其中：基金申购款	2,338,233,656.58	3,334,387,899.26	5,672,621,555.84
基金赎回款	-2,113,525,052.92	-3,032,211,449.37	-5,145,736,502.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,663,368,821.72	1,513,474,822.16	3,176,843,643.88

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	2,980,694.22	2,324,966.43
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	104,893.45	209,264.46
其他	68,031.29	137,140.54
合计	3,153,618.96	2,671,371.43

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
卖出股票成交总额	5,226,057,627.81	11,737,816,739.88
减：卖出股票成本总额	5,448,688,046.36	9,065,120,809.53
减：交易费用	14,458,961.79	-
买卖股票差价收入	-237,089,380.34	2,672,695,930.35

##### 7.4.7.11.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比区间均无证券出借差价收入。

#### 7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	19,472.65	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,765,717.67	5,165,212.99
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	17,785,190.32	5,165,212.99

#### 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 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	127,770,827.81	86,005,845.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	109,833,557.00	80,414,732.50
减：应计利息总额	169,803.60	425,899.74
减：交易费用	1,749.54	-
买卖债券差价收入	17,765,717.67	5,165,212.99

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金无衍生工具其他投资收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	51,247,121.72	28,332,216.68
其中：证券出借权益补偿收入	1,051,902.89	861,229.41
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	51,247,121.72	28,332,216.68

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1. 交易性金融资产	-4,683,168,578.95	805,827,472.11
——股票投资	-4,683,168,578.95	805,827,472.11
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
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	-4,683,168,578.95	805,827,472.11

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
基金赎回费收入	32,183,226.06	98,849,143.98



替代损益	-	-
其他	-	-
合计	32,183,226.06	98,849,143.98

#### 7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
审计费用	100,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	1,720.46	1,695.83
指数使用费	3,058,904.35	2,385,518.85
持有人大会- 公证费	-	-
持有人大会- 律师费	-	-
开户费	-	-
上市费	-	-
其他	-	41,732,952.10
合计	3,280,624.81	44,320,166.78

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金发起人
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人, 基金代销机构

东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	899,778,681.91	7.93	4,280,443,724.39	13.74

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	55,161,617.94	37.63

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	691,771.07	8.41	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	3,912,432.71	14.41	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	152,945,219.73	119,275,945.91
其中：支付销售机构的客户维护费	56,890,365.22	41,581,672.02

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至 2022年12月31日	2021年01月01日至 2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	15,294,521.99	11,927,594.55

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

## 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	422,612.89	422,612.89
东方证券股份有限公司	-	13,494.03	13,494.03
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,083,598.08	1,083,598.08
合计	-	1,519,705.00	1,519,705.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	合计
中国工商银行股份有限公司	-	380,258.08	380,258.08

东方证券股份有限公司	-	21,136.86	21,136.86
汇添富基金管理股份有限公司	-	1,069,901.41	1,069,901.41
合计	-	1,471,296.35	1,471,296.35

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

计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

单位：人民币元

本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	31,436,950.00	22,678.37	-	-
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	11,551,536.00	7,669.03	-	-

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

单位：人民币元

本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	2022010400000602	嘉元科技	2022年01月04日	1,263,400.00	10,000.00	14	3.60	1,768.76	-	-
东方证券	2022011100000690	天奈科技	2022年01月11日	268,420.00	2,000.00	14	3.60	375.79	-	-
东方证券	2022011800021638	嘉元科技	2022年01月18日	1,348,100.00	10,000.00	14	3.60	2,696.20	-	-
东方证券	2022012500011886	天奈科技	2022年01月25日	299,760.00	2,000.00	14	3.60	419.66	-	-

东方 证券	20220207000 01437	天奈科技	20 22 年 02 月 07 日	291,700.0 0	2,000. 00	14	3. 60	408.38	-	-
东方 证券	20220207000 46121	嘉元科技	20 22 年 02 月 07 日	1,206,600 .00	10,000 .00	14	3. 60	1,689. 24	-	-
东方 证券	20220208000 15274	天奈科技	20 22 年 02 月 08 日	281,880.0 0	2,000. 00	14	3. 60	394.63	-	-
东方 证券	20220221000 35971	天奈科技	20 22 年 02 月 21 日	275,120.0 0	2,000. 00	14	3. 60	385.17	-	-
东方 证券	20220221000 48287	嘉元科技	20 22 年 02 月 21 日	1,100,000 .00	10,000 .00	14	3. 60	1,540. 00	-	-
东方 证券	20220222000 13699	天奈科技	20 22 年 02 月 22 日	270,740.0 0	2,000. 00	14	3. 60	379.04	-	-
东 方	20220307000 37448	天奈	20 22	269,980.0 0	2,000. 00	14	3. 60	377.97	-	-

证 券		科 技	年 03 月 07 日							
东 方 证 券	20220307000 37450	嘉 元 科 技	20 22 年 03 月 07 日	971,000.0 0	10,000 .00	14	3. 60	1,359. 40	-	-
东 方 证 券	20220308000 13184	天 奈 科 技	20 22 年 03 月 08 日	269,700.0 0	2,000. 00	14	3. 60	377.58	-	-
东 方 证 券	20220321000 00799	新 宙 邦	20 22 年 03 月 21 日	85,380.00	1,000. 00	14	3. 40	129.02	-	-
东 方 证 券	20220321000 00800	当 升 科 技	20 22 年 03 月 21 日	84,260.00	1,000. 00	14	3. 40	127.33	-	-
东 方 证 券	20220321000 00801	特 锐 德	20 22 年 03 月 21 日	19,390.00	1,000. 00	14	3. 40	29.30	-	-
东 方 证 券	20220321000 00802	亿 纬 锂 能	20 22 年 03 月	85,400.00	1,000. 00	14	3. 40	129.05	-	-



			月 21 日							
东方 证券	20220321000 00803	赢 合 科 技	20 22 年 03 月 21 日	26,520.00	1,000. 00	14	3. 40	40.07	-	-
东方 证券	20220321000 00804	寒 锐 钻 业	20 22 年 03 月 21 日	67,070.00	1,000. 00	14	3. 40	101.35	-	-
东方 证券	20220321000 00806	汇 川 技 术	20 22 年 03 月 21 日	57,600.00	1,000. 00	14	3. 40	87.04	-	-
东方 证券	20220321000 00828	先 导 智 能	20 22 年 03 月 21 日	60,760.00	1,000. 00	14	3. 40	91.82	-	-
东方 证券	20220322000 14207	天 奈 科 技	20 22 年 03 月 22 日	301,200.0 0	2,000. 00	14	3. 60	451.80	-	-
东方 证券	20220406000 52259	赢 合 科 技	20 22 年 04 月 06	27,200.00	1,000. 00	14	3. 40	35.96	-	-

			日							
东方证券	20220406000 52269	寒锐钴业	2022年04月06日	62,580.00	1,000.00	14	3.40	82.74	-	-
东方证券	20220406000 52273	天奈科技	2022年04月06日	273,500.00	2,000.00	14	3.60	382.90	-	-
东方证券	20220406000 52275	汇川技术	2022年04月06日	56,450.00	1,000.00	14	3.40	74.64	-	-
东方证券	20220406000 60287	先导智能	2022年04月06日	54,120.00	1,000.00	14	3.40	71.56	-	-
东方证券	20220406000 60297	特锐德	2022年04月06日	18,500.00	1,000.00	14	3.40	24.46	-	-
东方证券	20220406000 60307	亿纬锂能	2022年04月06日	79,300.00	1,000.00	14	3.40	104.85	-	-
东	20220406000	新	20	83,030.00	1,000.00	14	3.40	109.78	-	-

方证券	66185	宙邦	22年04月06日		00		40			
东方证券	2022040600066199	当升科技	2022年04月06日	73,290.00	1,000.00	14	3.40	96.91	-	-
东方证券	2022041100000883	汇川技术	2022年04月11日	52,560.00	1,000.00	14	3.40	69.50	-	-
东方证券	2022042000043088	寒锐钴业	2022年04月20日	57,830.00	1,000.00	14	3.40	81.93	-	-
东方证券	2022042000043092	特锐德	2022年04月20日	16,040.00	1,000.00	14	3.40	22.72	-	-
东方证券	2022042000043102	亿纬锂能	2022年04月20日	67,600.00	1,000.00	14	3.40	95.77	-	-
东方证	2022042000043108	新宙邦	2022年	70,000.00	1,000.00	14	3.40	99.17	-	-

券			04 月 20 日							
东方 证券	20220420000 43110	先导 智能	20 22 年 04 月 20 日	46,900.00	1,000. 00	14	3. 40	66.44	-	-
东方 证券	20220420000 43112	天奈 科技	20 22 年 04 月 20 日	235,000.0 0	2,000. 00	14	3. 60	352.50	-	-
东方 证券	20220420000 43126	当升 科技	20 22 年 04 月 20 日	69,450.00	1,000. 00	14	3. 40	98.39	-	-
东方 证券	20220420000 44994	赢合 科技	20 22 年 04 月 20 日	22,950.00	1,000. 00	14	3. 40	32.51	-	-
东方 证券	20220420000 45024	汇川 技术	20 22 年 04 月 20 日	53,150.00	1,000. 00	14	3. 40	75.30	-	-
东方 证券	20220425000 05959	汇川 技术	20 22 年 04 月	47,500.00	1,000. 00	14	3. 40	62.81	-	-

			25日							
东方证券	2022050500063193	寒锐钴业	2022年05月05日	51,510.00	1,000.00	14	3.40	68.11	-	-
东方证券	2022050500063197	特锐德	2022年05月05日	13,800.00	1,000.00	14	3.40	18.25	-	-
东方证券	2022050500063223	亿纬锂能	2022年05月05日	65,880.00	1,000.00	14	3.40	87.11	-	-
东方证券	2022050500064461	赢合科技	2022年05月05日	17,990.00	1,000.00	14	3.40	23.79	-	-
东方证券	2022050500064467	当升科技	2022年05月05日	66,810.00	1,000.00	14	3.40	88.34	-	-
东方证券	2022050500064475	新宙邦	2022年05月05日	67,450.00	1,000.00	14	3.40	89.18	-	-

东方 证券	20220505000 64481	先导 智能	20 22 年 05 月 05 日	44,680.00	1,000. 00	14	3. 40	59.08	-	-
东方 证券	20220505000 64491	天奈 科技	20 22 年 05 月 05 日	228,000.0 0	2,000. 00	14	3. 60	319.20	-	-
东方 证券	20220505000 73439	汇川 技术	20 22 年 05 月 05 日	58,330.00	1,000. 00	14	3. 40	77.13	-	-
东方 证券	20220509000 00694	特锐 德	20 22 年 05 月 09 日	26,820.00	2,000. 00	14	3. 40	35.46	-	-
东方 证券	20220509000 00718	亿纬 锂能	20 22 年 05 月 09 日	128,680.0 0	2,000. 00	14	3. 40	170.14	-	-
东方 证券	20220509000 00724	汇川 技术	20 22 年 05 月 09 日	110,320.0 0	2,000. 00	14	3. 40	145.87	-	-
东 方	20220509000 00726	先 导	20 22	85,780.00	2,000. 00	14	3. 40	113.42	-	-

证券		智能	年 05 月 09 日							
东方 证券	20220509000 00728	新 宙 邦	20 22 年 05 月 09 日	140,000.0 0	2,000. 00	14	3. 40	185.11	-	-
东方 证券	20220509000 00730	当 升 科 技	20 22 年 05 月 09 日	133,260.0 0	2,000. 00	14	3. 40	176.20	-	-
东方 证券	20220509000 00732	赢 合 科 技	20 22 年 05 月 09 日	35,100.00	2,000. 00	14	3. 40	46.41	-	-
东方 证券	20220509000 00737	寒 锐 钻 业	20 22 年 05 月 09 日	101,320.0 0	2,000. 00	14	3. 40	133.97	-	-
东方 证券	20220509000 00740	翔 丰 华	20 22 年 05 月 09 日	75,360.00	2,000. 00	14	3. 40	99.64	-	-
东方 证券	20220509000 10411	汇 川 技 术	20 22 年 05 月 05 日	55,160.00	1,000. 00	14	3. 40	72.93	-	-

			月 09 日							
东方 证券	20220519000 41551	新 宙 邦	20 22 年 05 月 19 日	42,720.00	1,000. 00	14	3. 40	56.49	-	-
东方 证券	20220519000 41553	亿 纬 锂 能	20 22 年 05 月 19 日	79,700.00	1,000. 00	14	3. 40	105.38	-	-
东方 证券	20220519000 43663	当 升 科 技	20 22 年 05 月 19 日	71,800.00	1,000. 00	14	3. 40	94.94	-	-
东方 证券	20220519000 43665	寒 锐 钴 业	20 22 年 05 月 19 日	54,250.00	1,000. 00	14	3. 40	71.73	-	-
东方 证券	20220519000 43677	先 导 智 能	20 22 年 05 月 19 日	49,020.00	1,000. 00	14	3. 40	64.82	-	-
东方 证券	20220519000 43679	特 锐 德	20 22 年 05 月 19 日	14,930.00	1,000. 00	14	3. 40	19.74	-	-



			日							
东方证券	2022051900043699	赢合科技	2022年05月19日	20,190.00	1,000.00	14	3.40	26.70	-	-
东方证券	2022051900044055	天奈科技	2022年05月19日	269,760.00	2,000.00	14	3.60	377.66	-	-
东方证券	2022051900044063	汇川技术	2022年05月19日	59,600.00	1,000.00	14	3.40	78.80	-	-
东方证券	2022052300000647	中伟股份	2022年05月23日	209,300.00	2,000.00	14	3.40	276.74	-	-
东方证券	2022052300006813	寒锐钴业	2022年05月23日	111,040.00	2,000.00	14	3.40	146.82	-	-
东方证券	2022052300006815	翔丰华	2022年05月23日	89,700.00	2,000.00	14	3.40	118.60	-	-
东	20220523000	当	20	143,200.0	2,000.	14	3.	189.34	-	-

方 证 券	06819	升 科 技	22 年 05 月 23 日	0	00		40			
东 方 证 券	20220523000 06829	汇 川 技 术	20 22 年 05 月 23 日	60,700.00	1,000. 00	14	3. 40	80.26	-	-
东 方 证 券	20220523000 06847	赢 合 科 技	20 22 年 05 月 23 日	41,000.00	2,000. 00	14	3. 40	54.21	-	-
东 方 证 券	20220523000 06859	新 宙 邦	20 22 年 05 月 23 日	84,800.00	2,000. 00	14	3. 40	112.12	-	-
东 方 证 券	20220523000 06903	汇 川 技 术	20 22 年 05 月 23 日	121,400.0 0	2,000. 00	14	3. 40	160.52	-	-
东 方 证 券	20220523000 06931	先 导 智 能	20 22 年 05 月 23 日	97,320.00	2,000. 00	14	3. 40	128.68	-	-
东 方 证 券	20220523000 06937	亿 纬 锂	20 22 年	159,780.0 0	2,000. 00	14	3. 40	211.26	-	-

券		能	05 月 23 日							
东方证 券	20220523000 06947	特 锐 德	20 22 年 05 月 23 日	31,740.00	2,000. 00	14	3. 40	41.97	-	-
东方证 券	20220602000 13800	新 宙 邦	20 22 年 06 月 02 日	41,590.00	1,000. 00	14	3. 40	54.99	-	-
东方证 券	20220602000 13806	先 导 智 能	20 22 年 06 月 02 日	51,350.00	1,000. 00	14	3. 40	67.90	-	-
东方证 券	20220602000 13808	天 奈 科 技	20 22 年 06 月 02 日	276,500.0 0	2,000. 00	14	3. 60	387.10	-	-
东方证 券	20220602000 13812	特 锐 德	20 22 年 06 月 02 日	16,630.00	1,000. 00	14	3. 40	21.99	-	-
东方证 券	20220602000 13832	赢 合 科 技	20 22 年 06 月	21,290.00	1,000. 00	14	3. 40	28.15	-	-

			02 日							
东方 证券	20220602000 14316	汇川 技术	20 22 年 06 月 02 日	64,100.00	1,000. 00	14	3. 40	84.75	-	-
东方 证券	20220602000 14320	当升 科技	20 22 年 06 月 02 日	74,900.00	1,000. 00	14	3. 40	99.03	-	-
东方 证券	20220602000 14324	寒锐 钴业	20 22 年 06 月 02 日	55,160.00	1,000. 00	14	3. 40	72.93	-	-
东方 证券	20220602000 20812	亿纬 锂能	20 22 年 06 月 02 日	86,460.00	1,000. 00	14	3. 40	114.32	-	-
东方 证券	20220606000 12166	亿纬 锂能	20 22 年 06 月 06 日	181,620.0 0	2,000. 00	14	3. 40	240.14	-	-
东方 证券	20220606000 12168	赢合 科技	20 22 年 06 月 06 日	43,860.00	2,000. 00	14	3. 40	57.99	-	-

东方 证券	20220606000 12170	汇川 技术	20 22 年 06 月 06 日	131,300.0 0	2,000. 00	14	3. 40	173.61	-	-
东方 证券	20220606000 12172	寒锐 钴业	20 22 年 06 月 06 日	114,600.0 0	2,000. 00	14	3. 40	151.53	-	-
东方 证券	20220606000 12180	特锐 德	20 22 年 06 月 06 日	34,640.00	2,000. 00	14	3. 40	45.80	-	-
东方 证券	20220606000 14418	中伟 股份	20 22 年 06 月 06 日	235,100.0 0	2,000. 00	14	3. 40	310.85	-	-
东方 证券	20220606000 14422	当升 科技	20 22 年 06 月 06 日	157,600.0 0	2,000. 00	14	3. 40	208.38	-	-
东方 证券	20220606000 14426	汇川 技术	20 22 年 06 月 06 日	65,650.00	1,000. 00	14	3. 40	86.80	-	-
东 方	20220606000 14430	先 导	20 22	107,000.0 0	2,000. 00	14	3. 40	141.48	-	-

证券		智能	年 06 月 06 日							
东方 证券	20220606000 14446	新宙邦	20 22 年 06 月 06 日	89,000.00	2,000. 00	14	3. 40	117.68	-	-
东方 证券	20220613000 03370	震裕科技	20 22 年 06 月 13 日	263,820.0 0	2,000. 00	14	3. 40	348.83	-	-
东方 证券	20220616000 15205	寒锐钴业	20 22 年 06 月 16 日	57,100.00	1,000. 00	14	3. 40	75.50	-	-
东方 证券	20220616000 15217	亿纬锂能	20 22 年 06 月 16 日	95,500.00	1,000. 00	14	3. 40	126.27	-	-
东方 证券	20220616000 15221	当升科技	20 22 年 06 月 16 日	88,150.00	1,000. 00	14	3. 40	116.55	-	-
东方 证券	20220616000 18061	新宙邦	20 22 年 06 月 06 日	45,360.00	1,000. 00	14	3. 40	59.98	-	-

			月 16 日							
东方 证券	20220616000 18063	特 锐 德	20 22 年 06 月 16 日	16,990.00	1,000. 00	14	3. 40	22.46	-	-
东方 证券	20220616000 18077	先 导 智 能	20 22 年 06 月 16 日	61,510.00	1,000. 00	14	3. 40	81.33	-	-
东方 证券	20220616000 18081	天 奈 科 技	20 22 年 06 月 16 日	292,120.0 0	2,000. 00	14	3. 60	408.97	-	-
东方 证券	20220616000 18087	赢 合 科 技	20 22 年 06 月 16 日	24,010.00	1,000. 00	14	3. 40	31.75	-	-
东方 证券	20220616000 18095	汇 川 技 术	20 22 年 06 月 16 日	64,900.00	1,000. 00	14	3. 40	85.81	-	-
东方 证券	20220620000 01416	震 裕 科 技	20 22 年 06 月 20	304,000.0 0	2,000. 00	14	3. 40	401.96	-	-

			日							
东方证券	20220620000 01422	中伟股份	2022年06月20日	254,480.00	2,000.00	14	3.40	336.48	-	-
东方证券	20220620000 11108	特锐德	2022年06月20日	34,480.00	2,000.00	14	3.40	45.59	-	-
东方证券	20220620000 11110	中伟股份	2022年06月20日	254,480.00	2,000.00	14	3.40	336.48	-	-
东方证券	20220620000 11112	当升科技	2022年06月20日	188,000.00	2,000.00	14	3.40	248.58	-	-
东方证券	20220620000 11122	汇川技术	2022年06月20日	66,010.00	1,000.00	14	3.40	87.28	-	-
东方证券	20220620000 11126	先导智能	2022年06月20日	122,600.00	2,000.00	14	3.40	162.10	-	-
东	20220620000	亿	20	202,500.0	2,000.	14	3.	267.75	-	-



方 证 券	11128	纬 锂 能	22 年 06 月 20 日	0 00		40			
东 方 证 券	20220620000 11130	新 宙 邦	20 22 年 06 月 20 日	97,800.00	2,000. 00	14	3. 40	129.31	-
东 方 证 券	20220620000 12788	赢 合 科 技	20 22 年 06 月 20 日	50,680.00	2,000. 00	14	3. 40	67.01	-
东 方 证 券	20220620000 12792	寒 锐 钻 业	20 22 年 06 月 20 日	117,380.0 0	2,000. 00	14	3. 40	155.20	-
东 方 证 券	20220620000 12806	汇 川 技 术	20 22 年 06 月 20 日	132,020.0 0	2,000. 00	14	3. 40	174.56	-
东 方 证 券	20220627000 01186	中 伟 股 份	20 22 年 06 月 27 日	255,120.0 0	2,000. 00	14	3. 40	337.33	-
东 方 证 券	20220627000 14366	震 裕 科	20 22 年	307,580.0 0	2,000. 00	14	3. 40	406.69	-

券		技	06 月 27 日							
东方证 券	20220630000 16327	寒 锐 钴 业	20 22 年 06 月 30 日	57,920.00	1,000. 00	14	3. 40	76.58	-	-
东方证 券	20220630000 16331	亿 纬 锂 能	20 22 年 06 月 30 日	97,500.00	1,000. 00	14	3. 40	128.92	-	-
东方证 券	20220630000 16641	汇 川 技 术	20 22 年 06 月 30 日	65,870.00	1,000. 00	14	3. 40	87.09	-	-
东方证 券	20220630000 16887	当 升 科 技	20 22 年 06 月 30 日	90,340.00	1,000. 00	14	3. 40	119.45	-	-
东方证 券	20220630000 16893	新 宙 邦	20 22 年 06 月 30 日	52,560.00	1,000. 00	14	3. 40	69.50	-	-
东方证 券	20220630000 16895	特 锐 德	20 22 年 06 月	17,310.00	1,000. 00	14	3. 40	22.89	-	-

			30日							
东方证券	2022063000016907	先导智能	2022年06月30日	63,180.00	1,000.00	14	3.40	83.54	-	-
东方证券	2022063000016913	赢合科技	2022年06月30日	28,410.00	1,000.00	14	3.40	37.56	-	-
东方证券	2022070400000805	当升科技	2022年07月04日	93,050.00	1,000.00	14	3.40	123.03	-	-
东方证券	2022070400000807	汇川技术	2022年07月04日	65,750.00	1,000.00	14	3.40	86.94	-	-
东方证券	2022070400000809	新宙邦	2022年07月04日	55,550.00	1,000.00	14	3.40	73.45	-	-
东方证券	2022070400000811	特锐德	2022年07月04日	17,950.00	1,000.00	14	3.40	23.73	-	-

东方 证券	20220704000 00813	亿 纬 锂 能	20 22 年 07 月 04 日	96,540.00	1,000. 00	14	3. 40	127.65	-	-
东方 证券	20220704000 00815	中 伟 股 份	20 22 年 07 月 04 日	126,820.0 0	1,000. 00	14	3. 40	167.68	-	-
东方 证券	20220704000 00817	震 裕 科 技	20 22 年 07 月 04 日	139,050.0 0	1,000. 00	14	3. 40	183.86	-	-
东方 证券	20220704000 00819	宁 德 时 代	20 22 年 07 月 04 日	522,000.0 0	1,000. 00	14	3. 40	690.20	-	-
东方 证券	20220704000 00821	赢 合 科 技	20 22 年 07 月 04 日	28,680.00	1,000. 00	14	3. 40	37.92	-	-
东方 证券	20220704000 00823	寒 锐 钴 业	20 22 年 07 月 04 日	58,560.00	1,000. 00	14	3. 40	77.43	-	-
东 方	20220704000 14138	特 锐	20 22	35,900.00	2,000. 00	14	3. 40	47.47	-	-

证 券		德	年 07 月 04 日							
东 方 证 券	20220704000 14146	中 伟 股 份	20 22 年 07 月 04 日	253,640.0 0	2,000. 00	14	3. 40	335.37	-	-
东 方 证 券	20220704000 14152	当 升 科 技	20 22 年 07 月 04 日	186,100.0 0	2,000. 00	14	3. 40	246.07	-	-
东 方 证 券	20220704000 15582	汇 川 技 术	20 22 年 07 月 04 日	65,750.00	1,000. 00	14	3. 40	86.94	-	-
东 方 证 券	20220704000 15590	赢 合 科 技	20 22 年 07 月 04 日	57,360.00	2,000. 00	14	3. 40	75.84	-	-
东 方 证 券	20220704000 15592	汇 川 技 术	20 22 年 07 月 04 日	131,500.0 0	2,000. 00	14	3. 40	173.87	-	-
东 方 证 券	20220704000 15594	先 导 智 能	20 22 年 07 月 07 日	126,400.0 0	2,000. 00	14	3. 40	167.13	-	-

			月 04 日							
东方 证券	20220704000 15598	亿 纬 锂 能	20 22 年 07 月 04 日	193,080.0 0	2,000. 00	14	3. 40	255.29	-	-
东方 证券	20220704000 15602	寒 锐 钴 业	20 22 年 07 月 04 日	117,120.0 0	2,000. 00	14	3. 40	154.86	-	-
东方 证券	20220704000 15604	新 宙 邦	20 22 年 07 月 04 日	111,100.0 0	2,000. 00	14	3. 40	146.90	-	-
东方 证券	20220704000 16490	震 裕 科 技	20 22 年 07 月 04 日	278,100.0 0	2,000. 00	14	3. 40	367.71	-	-
东方 证券	20220704000 16500	中 伟 股 份	20 22 年 07 月 04 日	253,640.0 0	2,000. 00	14	3. 40	335.37	-	-
东方 证券	20220711000 16920	中 伟 股 份	20 22 年 07 月 11 日	278,100.0 0	2,000. 00	14	3. 40	367.71	-	-

			日							
东方证券	2022071100016926	震裕科技	2022年07月11日	276,020.00	2,000.00	14	3.40	364.96	-	-
东方证券	2022071400011316	特锐德	2022年07月14日	19,010.00	1,000.00	14	3.40	25.14	-	-
东方证券	2022071400011318	亿纬锂能	2022年07月14日	105,150.00	1,000.00	14	3.40	139.03	-	-
东方证券	2022071400011320	赢合科技	2022年07月14日	28,810.00	1,000.00	14	3.40	38.09	-	-
东方证券	2022071400011688	汇川技术	2022年07月14日	63,820.00	1,000.00	14	3.40	84.38	-	-
东方证券	2022071400013380	当升科技	2022年07月14日	108,970.00	1,000.00	14	3.40	144.08	-	-
东	20220714000	先	20	63,000.00	1,000.00	14	3.40	83.30	-	-

方 证 券	13386	导 智 能	22 年 07 月 14 日		00		40			
东 方 证 券	20220714000 13392	新 宙 邦	20 22 年 07 月 14 日	51,370.00	1,000. 00	14	3. 40	67.92	-	-
东 方 证 券	20220714000 14476	寒 锐 钻 业	20 22 年 07 月 14 日	58,080.00	1,000. 00	14	3. 60	81.31	-	-
东 方 证 券	20220718000 00681	天 华 超 净	20 22 年 07 月 18 日	84,710.00	1,000. 00	14	3. 40	112.01	-	-
东 方 证 券	20220718000 14439	亿 纬 锂 能	20 22 年 07 月 18 日	107,320.0 0	1,000. 00	14	3. 40	141.90	-	-
东 方 证 券	20220718000 14447	中 伟 股 份	20 22 年 07 月 18 日	153,580.0 0	1,000. 00	14	3. 40	203.07	-	-
东 方 证 券	20220718000 14453	震 裕 科	20 22 年	145,950.0 0	1,000. 00	14	3. 40	192.98	-	-



券		技	07 月 18 日							
东方证 券	20220718000 14459	宁 德 时 代	20 22 年 07 月 18 日	551,660.0 0	1,000. 00	14	3. 40	729.42	-	-
东方证 券	20220718000 14465	赢 合 科 技	20 22 年 07 月 18 日	27,880.00	1,000. 00	14	3. 40	36.86	-	-
东方证 券	20220718000 14473	寒 锐 钻 业	20 22 年 07 月 18 日	58,140.00	1,000. 00	14	3. 40	76.87	-	-
东方证 券	20220718000 15857	当 升 科 技	20 22 年 07 月 18 日	112,990.0 0	1,000. 00	14	3. 40	149.40	-	-
东方证 券	20220718000 15865	汇 川 技 术	20 22 年 07 月 18 日	63,100.00	1,000. 00	14	3. 40	83.43	-	-
东方证 券	20220718000 15871	特 锐 德	20 22 年 07 月	19,520.00	1,000. 00	14	3. 40	25.81	-	-

			18日							
东方证券	2022071800015875	新宙邦	2022年07月18日	49,530.00	1,000.00	14	3.40	65.49	-	-
东方证券	2022071800017119	中伟股份	2022年07月18日	307,160.00	2,000.00	14	3.40	406.13	-	-
东方证券	2022071800017131	赢合科技	2022年07月18日	55,760.00	2,000.00	14	3.40	73.73	-	-
东方证券	2022071800017151	汇川技术	2022年07月18日	126,200.00	2,000.00	14	3.40	166.86	-	-
东方证券	2022071800017161	当升科技	2022年07月18日	225,980.00	2,000.00	14	3.40	298.80	-	-
东方证券	2022071800017165	先导智能	2022年07月18日	126,380.00	2,000.00	14	3.40	167.10	-	-

东方 证券	20220718000 17169	中伟 股份	20 22 年 07 月 18 日	307,160.0 0	2,000. 00	14	3. 40	406.13	-	-
东方 证券	20220718000 17179	震裕 科技	20 22 年 07 月 18 日	291,900.0 0	2,000. 00	14	3. 40	385.96	-	-
东方 证券	20220718000 17191	汇川 技术	20 22 年 07 月 18 日	63,100.00	1,000. 00	14	3. 40	83.43	-	-
东方 证券	20220718000 17195	亿纬 锂能	20 22 年 07 月 18 日	214,640.0 0	2,000. 00	14	3. 40	283.80	-	-
东方 证券	20220718000 17203	特锐 德	20 22 年 07 月 18 日	39,040.00	2,000. 00	14	3. 40	51.62	-	-
东方 证券	20220718000 17221	寒锐 钴业	20 22 年 07 月 18 日	116,280.0 0	2,000. 00	14	3. 40	153.75	-	-
东 方	20220718000 17231	新宙	20 22	99,060.00	2,000. 00	14	3. 40	130.98	-	-

证 券		邦	年 07 月 18 日							
东 方 证 券	20220725000 00967	赢 合 科 技	20 22 年 07 月 25 日	29,250.00	1,000. 00	14	3. 40	38.68	-	-
东 方 证 券	20220725000 00969	天 华 超 净	20 22 年 07 月 25 日	78,150.00	1,000. 00	14	3. 40	103.33	-	-
东 方 证 券	20220725000 00975	寒 锐 钻 业	20 22 年 07 月 25 日	55,400.00	1,000. 00	14	3. 40	73.25	-	-
东 方 证 券	20220725000 00976	震 裕 科 技	20 22 年 07 月 25 日	137,030.0 0	1,000. 00	14	3. 40	181.18	-	-
东 方 证 券	20220725000 00977	德 方 纳 米	20 22 年 07 月 25 日	360,550.0 0	1,000. 00	14	3. 40	476.73	-	-
东 方 证 券	20220725000 15150	中 伟 股 份	20 22 年 07 月	262,840.0 0	2,000. 00	14	3. 40	347.53	-	-

			月 25 日							
东方 证券	20220725000 15164	震裕 科技	20 22 年 07 月 25 日	274,060.0 0	2,000. 00	14	3. 40	362.37	-	-
东方 证券	20220728000 10651	特锐 德	20 22 年 07 月 28 日	18,770.00	1,000. 00	14	3. 60	26.28	-	-
东方 证券	20220728000 10943	寒锐 钴业	20 22 年 07 月 28 日	55,040.00	1,000. 00	14	3. 60	77.06	-	-
东方 证券	20220728000 10947	亿纬 锂能	20 22 年 07 月 28 日	96,180.00	1,000. 00	14	3. 40	127.17	-	-
东方 证券	20220728000 10949	赢合 科技	20 22 年 07 月 28 日	30,260.00	1,000. 00	14	3. 40	40.01	-	-
东方 证券	20220728000 10957	汇川 技术	20 22 年 07 月 28	66,100.00	1,000. 00	14	3. 40	87.40	-	-

			日							
东方证券	2022072800010965	新宙邦	2022年07月28日	45,500.00	1,000.00	14	3.40	60.16	-	-
东方证券	2022072800013325	当升科技	2022年07月28日	94,180.00	1,000.00	14	3.40	124.53	-	-
东方证券	2022072800013339	先导智能	2022年07月28日	60,630.00	1,000.00	14	3.40	80.17	-	-
东方证券	2022080100000665	翔丰华	2022年08月01日	57,100.00	1,000.00	14	3.40	75.50	-	-
东方证券	2022080100000667	天华超净	2022年08月01日	79,280.00	1,000.00	14	3.40	104.83	-	-
东方证券	2022080100000679	中伟股份	2022年08月01日	266,320.00	2,000.00	14	3.40	352.13	-	-
东	20220801000	寒	20	111,920.0	2,000.	14	3.	147.98	-	-

方 证 券	12503	锐 钴 业	22 年 08 月 01 日	0	00		40			
东 方 证 券	20220801000 12525	汇 川 技 术	20 22 年 08 月 01 日	134,120.0 0	2,000. 00	14	3. 40	177.34	-	-
东 方 证 券	20220801000 12527	汇 川 技 术	20 22 年 08 月 01 日	67,060.00	1,000. 00	14	3. 40	88.67	-	-
东 方 证 券	20220801000 12553	新 宙 邦	20 22 年 08 月 01 日	92,820.00	2,000. 00	14	3. 40	122.73	-	-
东 方 证 券	20220801000 12555	新 宙 邦	20 22 年 08 月 01 日	46,410.00	1,000. 00	14	3. 40	61.36	-	-
东 方 证 券	20220801000 12559	赢 合 科 技	20 22 年 08 月 01 日	59,780.00	2,000. 00	14	3. 40	79.04	-	-
东 方 证 券	20220801000 12561	先 导 智	20 22 年	124,640.0 0	2,000. 00	14	3. 40	164.80	-	-

券		能	08 月 01 日							
东方 证券	20220801000 12599	亿 纬 锂 能	20 22 年 08 月 01 日	202,780.0 0	2,000. 00	14	3. 40	268.12	-	-
东方 证券	20220801000 12639	中 伟 股 份	20 22 年 08 月 01 日	266,320.0 0	2,000. 00	14	3. 40	352.13	-	-
东方 证券	20220801000 12641	中 伟 股 份	20 22 年 08 月 01 日	266,320.0 0	2,000. 00	14	3. 40	352.13	-	-
东方 证券	20220801000 12649	当 升 科 技	20 22 年 08 月 01 日	196,220.0 0	2,000. 00	14	3. 40	259.45	-	-
东方 证券	20220801000 12651	当 升 科 技	20 22 年 08 月 01 日	98,110.00	1,000. 00	14	3. 40	129.72	-	-
东方 证券	20220801000 12659	震 裕 科 技	20 22 年 08 月	273,500.0 0	2,000. 00	14	3. 40	361.63	-	-



			01 日							
东方 证券	20220801000 12665	特 锐 德	20 22 年 08 月 01 日	38,460.00	2,000. 00	14	3. 40	50.85	-	-
东方 证券	20220801000 13197	天 华 超 净	20 22 年 08 月 01 日	79,280.00	1,000. 00	14	3. 40	104.83	-	-
东方 证券	20220801000 13209	寒 锐 钻 业	20 22 年 08 月 01 日	55,960.00	1,000. 00	14	3. 40	73.99	-	-
东方 证券	20220801000 13211	特 锐 德	20 22 年 08 月 01 日	19,230.00	1,000. 00	14	3. 40	25.43	-	-
东方 证券	20220801000 13213	汇 川 技 术	20 22 年 08 月 01 日	67,060.00	1,000. 00	14	3. 40	88.67	-	-
东方 证券	20220801000 13273	赢 合 科 技	20 22 年 08 月 01 日	29,890.00	1,000. 00	14	3. 40	39.52	-	-

东方 证券	20220801000 13283	中伟 股份	20 22 年 08 月 01 日	133,160.0 0	1,000. 00	14	3. 40	176.07	-	-
东方 证券	20220801000 13289	震裕 科技	20 22 年 08 月 01 日	136,750.0 0	1,000. 00	14	3. 40	180.81	-	-
东方 证券	20220801000 13303	亿纬 锂能	20 22 年 08 月 01 日	101,390.0 0	1,000. 00	14	3. 40	134.06	-	-
东方 证券	20220801000 13305	宁德 时代	20 22 年 08 月 01 日	534,920.0 0	1,000. 00	14	3. 40	707.28	-	-
东方 证券	20220808000 01044	天华 超净	20 22 年 08 月 08 日	78,950.00	1,000. 00	14	3. 40	104.39	-	-
东方 证券	20220808000 01061	中伟 股份	20 22 年 08 月 08 日	250,000.0 0	2,000. 00	14	3. 40	330.56	-	-
东 方	20220808000 19659	震裕	20 22	129,550.0 0	1,000. 00	14	3. 40	171.29	-	-

证券		科技	年 08 月 08 日							
东方 证券	20220808000 19689	德方 纳米	20 22 年 08 月 08 日	403,480.0 0	1,000. 00	14	3. 40	533.49	-	-
东方 证券	20220808000 19695	寒锐 钴业	20 22 年 08 月 08 日	54,440.00	1,000. 00	14	3. 40	71.98	-	-
东方 证券	20220808000 19699	赢合 科技	20 22 年 08 月 08 日	29,230.00	1,000. 00	14	3. 40	38.65	-	-
东方 证券	20220808000 19713	天华 超净	20 22 年 08 月 08 日	78,950.00	1,000. 00	14	3. 40	104.39	-	-
东方 证券	20220808000 19737	震裕 科技	20 22 年 08 月 08 日	259,100.0 0	2,000. 00	14	3. 40	342.59	-	-
东方 证券	20220808000 19777	中伟 股份	20 22 年 08 月 08 日	250,000.0 0	2,000. 00	14	3. 40	330.56	-	-

			月 08 日							
东方 证券	20220811000 13332	赢 合 科 技	20 22 年 08 月 11 日	30,050.00	1,000. 00	14	3. 40	39.73	-	-
东方 证券	20220811000 13338	当 升 科 技	20 22 年 08 月 11 日	96,680.00	1,000. 00	14	3. 40	127.83	-	-
东方 证券	20220811000 13458	新 宙 邦	20 22 年 08 月 11 日	52,120.00	1,000. 00	14	3. 40	68.91	-	-
东方 证券	20220811000 14176	先 导 智 能	20 22 年 08 月 11 日	58,040.00	1,000. 00	14	3. 40	76.74	-	-
东方 证券	20220811000 14210	汇 川 技 术	20 22 年 08 月 11 日	63,000.00	1,000. 00	14	3. 40	83.30	-	-
东方 证券	20220811000 14242	寒 锐 钻 业	20 22 年 08 月 11 日	56,720.00	1,000. 00	14	3. 60	79.41	-	-

			日							
东方证券	2022081100014248	特锐德	2022年08月11日	18,460.00	1,000.00	14	3.60	25.84	-	-
东方证券	2022081100014252	亿纬锂能	2022年08月11日	98,580.00	1,000.00	14	3.40	130.34	-	-
东方证券	2022081500001257	中伟股份	2022年08月15日	242,760.00	2,000.00	14	3.40	320.98	-	-
东方证券	2022081500001270	震裕科技	2022年08月15日	274,800.00	2,000.00	14	3.40	363.35	-	-
东方证券	2022081500016297	翔丰华	2022年08月15日	59,230.00	1,000.00	14	3.40	78.32	-	-
东方证券	2022081500016381	寒锐钴业	2022年08月15日	115,660.00	2,000.00	14	3.40	152.93	-	-
东	20220815000	震	20	137,400.0	1,000.	14	3.	181.67	-	-

方 证 券	17529	裕 科 技	22 年 08 月 15 日	0	00		40			
东 方 证 券	20220815000 17535	特 锐 德	20 22 年 08 月 15 日	18,240.00	1,000. 00	14	3. 40	24.12	-	-
东 方 证 券	20220815000 17539	特 锐 德	20 22 年 08 月 15 日	36,480.00	2,000. 00	14	3. 40	48.23	-	-
东 方 证 券	20220815000 17543	亿 纬 锂 能	20 22 年 08 月 15 日	209,900.0 0	2,000. 00	14	3. 40	277.53	-	-
东 方 证 券	20220815000 17545	亿 纬 锂 能	20 22 年 08 月 15 日	104,950.0 0	1,000. 00	14	3. 40	138.77	-	-
东 方 证 券	20220815000 17557	中 伟 股 份	20 22 年 08 月 15 日	242,760.0 0	2,000. 00	14	3. 40	320.98	-	-
东 方 证 券	20220815000 17593	先 导 智	20 22 年	115,720.0 0	2,000. 00	14	3. 40	153.01	-	-

券		能	08月15日							
东方证券	2022081500017595	赢合科技	2022年08月15日	59,160.00	2,000.00	14	3.40	78.22	-	-
东方证券	2022081500018193	中伟股份	2022年08月15日	242,760.00	2,000.00	14	3.40	320.98	-	-
东方证券	2022081500018221	震裕科技	2022年08月15日	274,800.00	2,000.00	14	3.40	363.35	-	-
东方证券	2022081500018249	中伟股份	2022年08月15日	242,760.00	2,000.00	14	3.40	320.98	-	-
东方证券	2022081500018257	中伟股份	2022年08月15日	121,380.00	1,000.00	14	3.40	160.49	-	-
东方证券	2022081500018347	汇川技术	2022年08月	63,060.00	1,000.00	14	3.40	83.38	-	-

			15 日							
东方 证券	20220815000 18351	汇川 技术	20 22 年 08 月 15 日	63,060.00	1,000. 00	14	3. 40	83.38	-	-
东方 证券	20220815000 19351	寒锐 钴业	20 22 年 08 月 15 日	57,830.00	1,000. 00	14	3. 40	76.46	-	-
东方 证券	20220815000 19355	赢合 科技	20 22 年 08 月 15 日	29,580.00	1,000. 00	14	3. 40	39.11	-	-
东方 证券	20220815000 19395	宁德 时代	20 22 年 08 月 15 日	516,100.0 0	1,000. 00	14	3. 40	682.40	-	-
东方 证券	20220815000 19465	天华 超净	20 22 年 08 月 15 日	80,530.00	1,000. 00	14	3. 40	106.48	-	-
东方 证券	20220815000 19481	当升 科技	20 22 年 08 月 15 日	188,640.0 0	2,000. 00	14	3. 40	249.42	-	-



东方 证券	20220815000 19483	当升科技	20 22 年 08 月 15 日	94,320.00	1,000. 00	14	3. 40	124.71	-	-
东方 证券	20220815000 19485	汇川技术	20 22 年 08 月 15 日	126,120.0 0	2,000. 00	14	3. 40	166.76	-	-
东方 证券	20220815000 19503	天华超净	20 22 年 08 月 15 日	80,530.00	1,000. 00	14	3. 40	106.48	-	-
东方 证券	20220822000 18303	赢合科技	20 22 年 08 月 22 日	31,680.00	1,000. 00	14	3. 40	41.89	-	-
东方 证券	20220822000 18379	寒锐钴业	20 22 年 08 月 22 日	57,500.00	1,000. 00	14	3. 40	76.03	-	-
东方 证券	20220822000 18413	中伟股份	20 22 年 08 月 22 日	218,680.0 0	2,000. 00	14	3. 40	289.14	-	-
东 方	20220822000 18419	震裕	20 22	128,240.0 0	1,000. 00	14	3. 40	169.56	-	-

证券		科技	年 08 月 22 日							
东方 证券	20220822000 18421	震裕科技	20 22 年 08 月 22 日	256,480.0 0	2,000. 00	14	3. 40	339.12	-	-
东方 证券	20220822000 18435	德方纳米	20 22 年 08 月 22 日	374,210.0 0	1,000. 00	14	3. 40	494.79	-	-
东方 证券	20220822000 21627	天华超净	20 22 年 08 月 22 日	85,360.00	1,000. 00	14	3. 40	112.86	-	-
东方 证券	20220825000 12102	汇川技术	20 22 年 08 月 25 日	62,080.00	1,000. 00	14	3. 40	82.08	-	-
东方 证券	20220825000 12164	赢合科技	20 22 年 08 月 25 日	28,760.00	1,000. 00	14	3. 40	38.03	-	-
东方 证券	20220825000 12940	寒锐钴业	20 22 年 08 月 08 日	52,030.00	1,000. 00	14	3. 60	72.84	-	-

			月 25 日							
东方 证券	20220825000 12952	先导 智能	20 22 年 08 月 25 日	58,740.00	1,000. 00	14	3. 40	77.67	-	-
东方 证券	20220825000 12954	特锐 德	20 22 年 08 月 25 日	19,290.00	1,000. 00	14	3. 60	27.01	-	-
东方 证券	20220825000 12958	亿纬 锂能	20 22 年 08 月 25 日	104,850.0 0	1,000. 00	14	3. 40	138.64	-	-
东方 证券	20220825000 13222	当升 科技	20 22 年 08 月 25 日	83,900.00	1,000. 00	14	3. 40	110.93	-	-
东方 证券	20220829000 15527	寒锐 钴业	20 22 年 08 月 29 日	100,280.0 0	2,000. 00	14	3. 40	142.06	-	-
东方 证券	20220829000 15719	特锐 德	20 22 年 08 月 29	38,860.00	2,000. 00	14	3. 40	55.05	-	-

			日							
东方证券	2022082900015721	特锐德	2022年08月29日	19,430.00	1,000.00	14	3.40	27.53	-	-
东方证券	2022082900015727	亿纬锂能	2022年08月29日	203,840.00	2,000.00	14	3.40	288.77	-	-
东方证券	2022082900015739	震裕科技	2022年08月29日	224,160.00	2,000.00	14	3.40	317.56	-	-
东方证券	2022082900015741	震裕科技	2022年08月29日	112,080.00	1,000.00	14	3.40	158.78	-	-
东方证券	2022082900015749	翔丰华	2022年08月29日	53,310.00	1,000.00	14	3.40	75.52	-	-
东方证券	2022082900015797	中伟股份	2022年08月29日	197,000.00	2,000.00	14	3.40	279.08	-	-
东	20220829000	中	20	197,000.0	2,000.	14	3.	279.08	-	-

方 证 券	17323	伟 股 份	22 年 08 月 29 日	0 00		40			
东 方 证 券	20220829000 17325	震 裕 科 技	20 22 年 08 月 29 日	224,160.0 0	2,000. 00	14	3. 40	317.56	- -
东 方 证 券	20220829000 17403	亿 纬 锂 能	20 22 年 08 月 29 日	101,920.0 0	1,000. 00	14	3. 40	144.39	- -
东 方 证 券	20220829000 18641	宁 德 时 代	20 22 年 08 月 29 日	502,000.0 0	1,000. 00	14	3. 40	711.17	- -
东 方 证 券	20220829000 18647	先 导 智 能	20 22 年 08 月 29 日	115,060.0 0	2,000. 00	14	3. 40	163.00	- -
东 方 证 券	20220829000 18649	赢 合 科 技	20 22 年 08 月 29 日	58,640.00	2,000. 00	14	3. 40	83.07	- -
东 方 证 券	20220829000 18855	赢 合 科 技	20 22 年	29,320.00	1,000. 00	14	3. 40	41.54	- -

券		技	08月29日							
东方证券	2022082900018875	当升科技	2022年08月29日	166,320.00	2,000.00	14	3.40	235.62	-	-
东方证券	2022082900018877	当升科技	2022年08月29日	83,160.00	1,000.00	14	3.40	117.81	-	-
东方证券	2022082900018883	汇川技术	2022年08月29日	58,980.00	1,000.00	14	3.40	83.56	-	-
东方证券	2022082900018885	汇川技术	2022年08月29日	58,980.00	1,000.00	14	3.40	83.56	-	-
东方证券	2022082900018887	汇川技术	2022年08月29日	117,960.00	2,000.00	14	3.40	167.11	-	-
东方证券	2022082900018907	寒锐钴业	2022年08月	50,140.00	1,000.00	14	3.40	71.03	-	-

			29 日							
东方 证券	20220829000 18925	天华 超净	20 22 年 08 月 29 日	79,230.00	1,000. 00	14	3. 40	112.24	-	-
东方 证券	20220829000 18927	天华 超净	20 22 年 08 月 29 日	79,230.00	1,000. 00	14	3. 40	112.24	-	-
东方 证券	20220829000 18939	中伟 股份	20 22 年 08 月 29 日	98,500.00	1,000. 00	14	3. 40	139.54	-	-
东方 证券	20220829000 18943	中伟 股份	20 22 年 08 月 29 日	197,000.0 0	2,000. 00	14	3. 40	279.08	-	-
东方 证券	20220829000 18945	中伟 股份	20 22 年 08 月 29 日	197,000.0 0	2,000. 00	14	3. 40	279.08	-	-
东方 证券	20220905000 21017	中伟 股份	20 22 年 09 月 05 日	184,020.0 0	2,000. 00	14	3. 40	243.32	-	-

东方 证券	20220905000 21045	震裕科技	20 22 年 09 月 05 日	97,600.00	1,000. 00	14	3. 40	129.05	-	-
东方 证券	20220905000 21047	震裕科技	20 22 年 09 月 05 日	195,200.0 0	2,000. 00	14	3. 40	258.10	-	-
东方 证券	20220905000 21089	天华超净	20 22 年 09 月 05 日	72,970.00	1,000. 00	14	3. 40	96.48	-	-
东方 证券	20220905000 22767	寒锐钴业	20 22 年 09 月 05 日	50,600.00	1,000. 00	14	3. 40	66.90	-	-
东方 证券	20220905000 22787	德方纳米	20 22 年 09 月 05 日	308,800.0 0	1,000. 00	14	3. 40	408.30	-	-
东方 证券	20220905000 22805	赢合科技	20 22 年 09 月 05 日	26,340.00	1,000. 00	14	3. 40	34.83	-	-
东 方	20220913000 21883	宁德	20 22	456,910.0 0	1,000. 00	14	3. 40	604.14	-	-



证 券		时 代	年 09 月 13 日							
东 方 证 券	20220913000 21957	特 锐 德	20 22 年 09 月 13 日	32,740.00	2,000. 00	14	3. 40	43.29	-	-
东 方 证 券	20220913000 24227	赢 合 科 技	20 22 年 09 月 13 日	53,440.00	2,000. 00	14	3. 40	70.66	-	-
东 方 证 券	20220913000 24249	特 锐 德	20 22 年 09 月 13 日	16,370.00	1,000. 00	14	3. 40	21.64	-	-
东 方 证 券	20220913000 24283	寒 锐 钻 业	20 22 年 09 月 13 日	103,640.0 0	2,000. 00	14	3. 40	137.04	-	-
东 方 证 券	20220913000 24299	震 裕 科 技	20 22 年 09 月 13 日	104,860.0 0	1,000. 00	14	3. 40	138.65	-	-
东 方 证 券	20220913000 24305	震 裕 科 技	20 22 年 09 月 09	209,720.0 0	2,000. 00	14	3. 40	277.30	-	-

			月 13 日							
东方 证券	20220913000 24335	翔 丰 华	20 22 年 09 月 13 日	49,830.00	1,000. 00	14	3. 40	65.89	-	-
东方 证券	20220913000 24339	中 伟 股 份	20 22 年 09 月 13 日	188,980.0 0	2,000. 00	14	3. 40	249.87	-	-
东方 证券	20220913000 24341	中 伟 股 份	20 22 年 09 月 13 日	188,980.0 0	2,000. 00	14	3. 40	249.87	-	-
东方 证券	20220913000 26759	亿 纬 锂 能	20 22 年 09 月 13 日	193,960.0 0	2,000. 00	14	3. 40	256.46	-	-
东方 证券	20220913000 26765	亿 纬 锂 能	20 22 年 09 月 13 日	96,980.00	1,000. 00	14	3. 40	128.23	-	-
东方 证券	20220913000 26775	当 升 科 技	20 22 年 09 月 13 日	156,200.0 0	2,000. 00	14	3. 40	206.53	-	-

			日							
东方证券	20220913000 26793	汇川技术	2022年09月13日	58,700.00	1,000.00	14	3.40	77.61	-	-
东方证券	20220913000 26795	汇川技术	2022年09月13日	58,700.00	1,000.00	14	3.40	77.61	-	-
东方证券	20220913000 26797	汇川技术	2022年09月13日	117,400.00	2,000.00	14	3.40	155.23	-	-
东方证券	20220913000 26837	震裕科技	2022年09月13日	209,720.00	2,000.00	14	3.40	277.30	-	-
东方证券	20220913000 28783	先导智能	2022年09月13日	109,260.00	2,000.00	14	3.40	144.47	-	-
东方证券	20220913000 28785	赢合科技	2022年09月13日	26,720.00	1,000.00	14	3.40	35.33	-	-
东	20220913000	当	20	78,100.00	1,000.00	14	3.40	103.27	-	-

方 证 券	28831	升 科 技	22 年 09 月 13 日		00		40			
东 方 证 券	20220913000 28841	寒 锐 钻 业	20 22 年 09 月 13 日	51,820.00	1,000. 00	14	3. 40	68.52	-	-
东 方 证 券	20220913000 28863	天 华 超 净	20 22 年 09 月 13 日	78,650.00	1,000. 00	14	3. 40	103.99	-	-
东 方 证 券	20220913000 28865	天 华 超 净	20 22 年 09 月 13 日	78,650.00	1,000. 00	14	3. 40	103.99	-	-
东 方 证 券	20220913000 28875	中 伟 股 份	20 22 年 09 月 13 日	94,490.00	1,000. 00	14	3. 40	124.94	-	-
东 方 证 券	20220913000 28877	中 伟 股 份	20 22 年 09 月 13 日	188,980.0 0	2,000. 00	14	3. 40	249.87	-	-
东 方 证 券	20220913000 28879	中 伟 股 份	20 22 年	188,980.0 0	2,000. 00	14	3. 40	249.87	-	-

券		份	09 月 13 日							
东方证 券	20220927000 22563	寒 锐 钻 业	20 22 年 09 月 27 日	47,540.00	1,000. 00	14	3. 40	62.86	-	-
东方证 券	20220927000 22587	当 升 科 技	20 22 年 09 月 27 日	142,000.0 0	2,000. 00	14	3. 40	187.76	-	-
东方证 券	20220927000 22589	当 升 科 技	20 22 年 09 月 27 日	71,000.00	1,000. 00	14	3. 40	93.88	-	-
东方证 券	20220927000 22601	震 裕 科 技	20 22 年 09 月 27 日	189,200.0 0	2,000. 00	14	3. 40	250.16	-	-
东方证 券	20220927000 22623	亿 纬 锂 能	20 22 年 09 月 27 日	180,060.0 0	2,000. 00	14	3. 40	238.08	-	-
东方证 券	20220927000 22625	天 华 超 净	20 22 年 09 月	69,580.00	1,000. 00	14	3. 40	92.00	-	-

			27日							
东方证券	20220927000 22639	汇川技术	2022年09月27日	115,900.00	2,000.00	14	3.40	153.25	-	-
东方证券	20220927000 24561	寒锐钴业	2022年09月27日	95,080.00	2,000.00	14	3.40	125.72	-	-
东方证券	20220927000 24635	震裕科技	2022年09月27日	94,600.00	1,000.00	14	3.40	125.08	-	-
东方证券	20220927000 24637	震裕科技	2022年09月27日	189,200.00	2,000.00	14	3.40	250.16	-	-
东方证券	20220927000 24703	亿纬锂能	2022年09月27日	90,030.00	1,000.00	14	3.40	119.04	-	-
东方证券	20220927000 24707	天华超净	2022年09月27日	69,580.00	1,000.00	14	3.40	92.00	-	-

东方 证券	20220927000 24713	赢 合 科 技	20 22 年 09 月 27 日	49,780.00	2,000. 00	14	3. 40	65.82	-	-
东方 证券	20220927000 24913	翔 丰 华	20 22 年 09 月 27 日	47,280.00	1,000. 00	14	3. 50	64.35	-	-
东方 证券	20220927000 24915	中 伟 股 份	20 22 年 09 月 27 日	177,480.0 0	2,000. 00	14	3. 50	241.57	-	-
东方 证券	20220927000 24917	中 伟 股 份	20 22 年 09 月 27 日	88,740.00	1,000. 00	14	3. 50	120.79	-	-
东方 证券	20220927000 24919	中 伟 股 份	20 22 年 09 月 27 日	177,480.0 0	2,000. 00	14	3. 50	241.57	-	-
东方 证券	20220927000 24921	中 伟 股 份	20 22 年 09 月 27 日	177,480.0 0	2,000. 00	14	3. 50	241.57	-	-
东 方	20220927000 28043	中 伟	20 22	177,480.0 0	2,000. 00	14	3. 50	241.57	-	-

证券		股份	年 09 月 27 日							
东方 证券	20220927000 28483	赢合科技	20 22 年 09 月 27 日	24,890.00	1,000. 00	14	3. 40	32.91	-	-
东方 证券	20220927000 28727	宁德时代	20 22 年 09 月 27 日	429,500.0 0	1,000. 00	14	3. 40	567.89	-	-
东方 证券	20220927000 28777	特锐德	20 22 年 09 月 27 日	30,700.00	2,000. 00	14	3. 40	40.59	-	-
东方 证券	20220927000 28781	特锐德	20 22 年 09 月 27 日	15,350.00	1,000. 00	14	3. 40	20.30	-	-
东方 证券	20220927000 29059	先导智能	20 22 年 09 月 27 日	101,840.0 0	2,000. 00	14	3. 40	134.66	-	-
东方 证券	20220927000 29131	汇川技术	20 22 年 09 月 27 日	57,950.00	1,000. 00	14	3. 40	76.62	-	-



			月 27 日							
东方 证券	20221011000 23541	寒 锐 钻 业	20 22 年 10 月 11 日	43,290.00	1,000. 00	14	3. 40	57.24	-	-
东方 证券	20221011000 23965	当 升 科 技	20 22 年 10 月 11 日	130,640.0 0	2,000. 00	14	3. 40	172.74	-	-
东方 证券	20221011000 23967	当 升 科 技	20 22 年 10 月 11 日	65,320.00	1,000. 00	14	3. 40	86.37	-	-
东方 证券	20221011000 23969	汇 川 技 术	20 22 年 10 月 11 日	117,080.0 0	2,000. 00	14	3. 40	154.81	-	-
东方 证券	20221011000 26441	寒 锐 钻 业	20 22 年 10 月 11 日	86,580.00	2,000. 00	14	3. 40	114.48	-	-
东方 证券	20221011000 26461	亿 纬 锂 能	20 22 年 10 月 11 日	174,320.0 0	2,000. 00	14	3. 40	230.49	-	-

			日							
东方证券	20221011000 26465	天华超净	2022年10月11日	65,130.00	1,000.00	14	3.40	86.12	-	-
东方证券	20221011000 26513	震裕科技	2022年10月11日	175,680.00	2,000.00	14	3.40	232.29	-	-
东方证券	20221011000 27557	宁德时代	2022年10月11日	416,300.00	1,000.00	14	3.40	550.44	-	-
东方证券	20221011000 27585	特锐德	2022年10月11日	14,360.00	1,000.00	14	3.40	18.99	-	-
东方证券	20221011000 27587	特锐德	2022年10月11日	28,720.00	2,000.00	14	3.40	37.97	-	-
东方证券	20221011000 27597	亿纬锂能	2022年10月11日	87,160.00	1,000.00	14	3.40	115.24	-	-
东	20221011000	天	20	65,130.00	1,000.00	14	3.40	86.12	-	-

方 证 券	27607	华 超 净	22 年 10 月 11 日		00		40			
东 方 证 券	20221011000 27617	赢 合 科 技	20 22 年 10 月 11 日	46,880.00	2,000. 00	14	3. 40	61.99	-	-
东 方 证 券	20221011000 27619	赢 合 科 技	20 22 年 10 月 11 日	23,440.00	1,000. 00	14	3. 40	30.99	-	-
东 方 证 券	20221011000 27649	中 伟 股 份	20 22 年 10 月 11 日	159,480.0 0	2,000. 00	14	3. 50	217.07	-	-
东 方 证 券	20221011000 27651	中 伟 股 份	20 22 年 10 月 11 日	159,480.0 0	2,000. 00	14	3. 50	217.07	-	-
东 方 证 券	20221011000 27653	中 伟 股 份	20 22 年 10 月 11 日	159,480.0 0	2,000. 00	14	3. 50	217.07	-	-
东 方 证 券	20221011000 27655	中 伟 股 份	20 22 年	79,740.00	1,000. 00	14	3. 50	108.54	-	-

券		份	10月11日							
东方证券	2022101100027657	中伟股份	2022年10月11日	159,480.00	2,000.00	14	3.50	217.07	-	-
东方证券	2022101100027669	汇川技术	2022年10月11日	58,540.00	1,000.00	14	3.40	77.40	-	-
东方证券	2022101100027689	翔丰华	2022年10月11日	43,500.00	1,000.00	14	3.50	59.21	-	-
东方证券	2022101100027695	先导智能	2022年10月11日	95,560.00	2,000.00	14	3.40	126.35	-	-
东方证券	2022101100027707	震裕科技	2022年10月11日	87,840.00	1,000.00	14	3.40	116.14	-	-
东方证券	2022101100027709	震裕科技	2022年10月	175,680.00	2,000.00	14	3.40	232.29	-	-

			11日							
东方证券	2022101700000845	汇川技术	2022年10月17日	132,000.00	2,000.00	14	3.40	174.53	-	-
东方证券	2022101700000850	亿纬锂能	2022年10月17日	182,980.00	2,000.00	14	3.40	241.94	-	-
东方证券	2022101700000851	特锐德	2022年10月17日	31,240.00	2,000.00	14	3.40	41.31	-	-
东方证券	2022101700000853	寒锐钴业	2022年10月17日	90,680.00	2,000.00	14	3.40	119.90	-	-
东方证券	2022101700000854	当升科技	2022年10月17日	130,380.00	2,000.00	14	3.40	172.39	-	-
东方证券	2022101700000860	先导智能	2022年10月17日	105,060.00	2,000.00	14	3.40	138.91	-	-

东方 证券	20221017000 00862	赢 合 科 技	20 22 年 10 月 17 日	50,060.00	2,000. 00	14	3. 40	66.19	-	-
东方 证券	20221025000 22436	天 华 超 净	20 22 年 10 月 25 日	66,250.00	1,000. 00	14	3. 40	87.60	-	-
东方 证券	20221025000 22440	天 华 超 净	20 22 年 10 月 25 日	66,250.00	1,000. 00	14	3. 40	87.60	-	-
东方 证券	20221025000 23222	震 裕 科 技	20 22 年 10 月 25 日	178,800.0 0	2,000. 00	14	3. 40	236.41	-	-
东方 证券	20221025000 23876	寒 锐 钴 业	20 22 年 10 月 25 日	43,210.00	1,000. 00	14	3. 40	57.13	-	-
东方 证券	20221025000 26450	宁 德 时 代	20 22 年 10 月 25 日	401,700.0 0	1,000. 00	14	3. 40	531.14	-	-
东 方	20221025000 26464	震 裕	20 22	178,800.0 0	2,000. 00	14	3. 40	236.41	-	-

证券		科技	年 10 月 25 日							
东方 证券	20221025000 26466	震裕 科技	20 22 年 10 月 25 日	89,400.00	1,000. 00	14	3. 40	118.21	-	-
东方 证券	20221025000 26482	特锐 德	20 22 年 10 月 25 日	15,620.00	1,000. 00	14	3. 40	20.65	-	-
东方 证券	20221025000 26510	中伟 股份	20 22 年 10 月 25 日	76,580.00	1,000. 00	14	3. 50	104.23	-	-
东方 证券	20221025000 26512	中伟 股份	20 22 年 10 月 25 日	153,160.0 0	2,000. 00	14	3. 50	208.47	-	-
东方 证券	20221025000 26514	汇川 技术	20 22 年 10 月 25 日	66,600.00	1,000. 00	14	3. 40	88.06	-	-
东方 证券	20221025000 26624	当升 科技	20 22 年 10 月 10	63,830.00	1,000. 00	14	3. 40	84.40	-	-

			月 25 日							
东方 证券	20221025000 29396	亿 纬 锂 能	20 22 年 10 月 25 日	92,000.00	1,000. 00	14	3. 40	121.64	-	-
东方 证券	20221025000 29418	赢 合 科 技	20 22 年 10 月 25 日	21,210.00	1,000. 00	14	3. 40	28.04	-	-
东方 证券	20221025000 29464	翔 丰 华	20 22 年 10 月 25 日	47,170.00	1,000. 00	14	3. 50	64.20	-	-
东方 证券	20221025000 29474	中 伟 股 份	20 22 年 10 月 25 日	153,160.0 0	2,000. 00	14	3. 50	208.47	-	-
东方 证券	20221025000 29476	中 伟 股 份	20 22 年 10 月 25 日	153,160.0 0	2,000. 00	14	3. 50	208.47	-	-
东方 证券	20221025000 29478	中 伟 股 份	20 22 年 10 月 25 日	153,160.0 0	2,000. 00	14	3. 50	208.47	-	-



			日							
东方证券	20221031000 06239	亿纬锂能	2022年10月31日	166,080.00	2,000.00	14	3.40	219.59	-	-
东方证券	20221031000 06243	先导智能	2022年10月31日	100,180.00	2,000.00	14	3.40	132.46	-	-
东方证券	20221031000 06247	特锐德	2022年10月31日	30,080.00	2,000.00	14	3.40	39.77	-	-
东方证券	20221031000 06253	汇川技术	2022年10月31日	133,400.00	2,000.00	14	3.40	176.38	-	-
东方证券	20221031000 06867	寒锐钴业	2022年10月31日	80,380.00	2,000.00	14	3.40	106.28	-	-
东方证券	20221031000 06869	赢合科技	2022年10月31日	39,780.00	2,000.00	14	3.40	52.60	-	-
东	20221031000	当	20	117,980.0	2,000.	14	3.	156.00	-	-

方 证 券	06873	升 科 技	22 年 10 月 31 日	0	00		40			
东 方 证 券	20221108000 23861	汇 川 技 术	20 22 年 11 月 08 日	69,260.00	1,000. 00	14	3. 40	91.58	-	-
东 方 证 券	20221108000 23969	中 伟 股 份	20 22 年 11 月 08 日	87,570.00	1,000. 00	14	3. 50	119.19	-	-
东 方 证 券	20221108000 23971	中 伟 股 份	20 22 年 11 月 08 日	175,140.0 0	2,000. 00	14	3. 50	238.39	-	-
东 方 证 券	20221108000 25171	震 裕 科 技	20 22 年 11 月 08 日	190,760.0 0	2,000. 00	14	3. 40	252.23	-	-
东 方 证 券	20221108000 25173	震 裕 科 技	20 22 年 11 月 08 日	190,760.0 0	2,000. 00	14	3. 40	252.23	-	-
东 方 证 券	20221108000 25635	中 伟 股 份	20 22 年	175,140.0 0	2,000. 00	14	3. 50	238.39	-	-

券		份	11月08日							
东方证券	2022110800025673	当升科技	2022年11月08日	65,950.00	1,000.00	14	3.40	87.20	-	-
东方证券	2022110800025705	赢合科技	2022年11月08日	20,990.00	1,000.00	14	3.40	27.75	-	-
东方证券	2022110800025709	亿纬锂能	2022年11月08日	96,630.00	1,000.00	14	3.40	127.77	-	-
东方证券	2022110800028857	天华超净	2022年11月08日	70,200.00	1,000.00	14	3.40	92.82	-	-
东方证券	2022110800029895	震裕科技	2022年11月08日	95,380.00	1,000.00	14	3.40	126.11	-	-
东方证券	2022110800030285	寒锐钴业	2022年11月	44,920.00	1,000.00	14	3.40	59.39	-	-

			08日							
东方证券	2022110800030529	翔丰华	2022年11月08日	42,990.00	1,000.00	14	3.50	58.51	-	-
东方证券	2022110800030531	中伟股份	2022年11月08日	175,140.00	2,000.00	14	3.50	238.39	-	-
东方证券	2022110800030535	天华超净	2022年11月08日	70,200.00	1,000.00	14	3.40	92.82	-	-
东方证券	2022110800030565	特锐德	2022年11月08日	15,970.00	1,000.00	14	3.40	21.12	-	-
东方证券	2022110800030729	宁德时代	2022年11月08日	409,800.00	1,000.00	14	3.40	541.85	-	-
东方证券	2022111400000943	嘉元科技	2022年11月14日	532,100.00	10,000.00	14	3.40	703.55	-	-

东方 证券	20221114000 00945	容 百 科 技	20 22 年 11 月 14 日	832,300.0 0	10,000 .00	14	3. 40	1,100. 49	-	-
东方 证券	20221114000 00949	天 奈 科 技	20 22 年 11 月 14 日	504,050.0 0	5,000. 00	14	3. 40	666.47	-	-
东方 证券	20221114000 08047	特 锐 德	20 22 年 11 月 14 日	31,280.00	2,000. 00	14	3. 40	41.36	-	-
东方 证券	20221114000 08057	亿 纬 锂 能	20 22 年 11 月 14 日	176,720.0 0	2,000. 00	14	3. 40	233.66	-	-
东方 证券	20221114000 08063	寒 锐 钴 业	20 22 年 11 月 14 日	88,500.00	2,000. 00	14	3. 40	117.02	-	-
东方 证券	20221114000 08065	先 导 智 能	20 22 年 11 月 14 日	98,200.00	2,000. 00	14	3. 40	129.84	-	-
东 方	20221114000 08201	赢 合	20 22	40,380.00	2,000. 00	14	3. 40	53.39	-	-

证 券		科 技	年 11 月 14 日							
东 方 证 券	20221114000 08215	当 升 科 技	20 22 年 11 月 14 日	121,800.0 0	2,000. 00	14	3. 40	161.05	-	-
东 方 证 券	20221114000 08221	汇 川 技 术	20 22 年 11 月 14 日	139,800.0 0	2,000. 00	14	3. 40	184.85	-	-
东 方 证 券	20221122000 16985	寒 锐 钻 业	20 22 年 11 月 22 日	44,500.00	1,000. 00	14	3. 40	58.84	-	-
东 方 证 券	20221122000 16991	赢 合 科 技	20 22 年 11 月 22 日	19,860.00	1,000. 00	14	3. 40	26.26	-	-
东 方 证 券	20221122000 16997	汇 川 技 术	20 22 年 11 月 22 日	70,750.00	1,000. 00	14	3. 40	93.55	-	-
东 方 证 券	20221122000 17045	亿 纬 锂 能	20 22 年 11 月	82,650.00	1,000. 00	14	3. 40	109.28	-	-

			月 22 日							
东方 证券	20221122000 17061	特 锐 德	20 22 年 11 月 22 日	16,210.00	1,000. 00	14	3. 40	21.43	-	-
东方 证券	20221122000 18341	震 裕 科 技	20 22 年 11 月 22 日	84,110.00	1,000. 00	14	3. 40	111.21	-	-
东方 证券	20221122000 18343	震 裕 科 技	20 22 年 11 月 22 日	168,220.0 0	2,000. 00	14	3. 40	222.42	-	-
东方 证券	20221122000 18349	天 华 超 净	20 22 年 11 月 22 日	62,220.00	1,000. 00	14	3. 40	82.27	-	-
东方 证券	20221122000 19341	当 升 科 技	20 22 年 11 月 22 日	59,730.00	1,000. 00	14	3. 40	78.98	-	-
东方 证券	20221122000 19421	翔 丰 华	20 22 年 11 月 22 日	39,020.00	1,000. 00	14	3. 50	53.11	-	-

			日							
东方证券	2022112200019481	震裕科技	2022年11月22日	168,220.00	2,000.00	14	3.40	222.42	-	-
东方证券	2022112200019487	天华超净	2022年11月22日	62,220.00	1,000.00	14	3.40	82.27	-	-
东方证券	2022112200021141	宁德时代	2022年11月22日	375,000.00	1,000.00	14	3.40	495.83	-	-
东方证券	2022112800008305	天奈科技	2022年11月28日	478,950.00	5,000.00	7	3.40	316.64	-	-
东方证券	2022112800008327	特锐德	2022年11月28日	31,360.00	2,000.00	7	3.40	20.73	-	-
东方证券	2022112800008337	先导智能	2022年11月28日	86,980.00	2,000.00	7	3.40	57.50	-	-
东	20221128000	赢	20	39,080.00	2,000.00	7	3.40	25.84	-	-



方 证 券	08341	合 科 技	22 年 11 月 28 日		00		40			
东 方 证 券	20221128000 08795	嘉 元 科 技	20 22 年 11 月 28 日	503,400.0 0	10,000 .00	7	3. 40	332.80	-	-
东 方 证 券	20221128000 08797	容 百 科 技	20 22 年 11 月 28 日	739,400.0 0	10,000 .00	7	3. 40	488.83	-	-
东 方 证 券	20221128000 09181	亿 纬 锂 能	20 22 年 11 月 28 日	163,320.0 0	2,000. 00	7	3. 40	107.97	-	-
东 方 证 券	20221128000 09187	寒 锐 钻 业	20 22 年 11 月 28 日	84,800.00	2,000. 00	7	3. 40	56.06	-	-
东 方 证 券	20221128000 09197	当 升 科 技	20 22 年 11 月 28 日	117,800.0 0	2,000. 00	7	3. 40	77.88	-	-
东 方 证 券	20221128000 09203	汇 川 技	20 22 年	136,860.0 0	2,000. 00	7	3. 40	90.48	-	-

券		术	11月28日							
东方证券	2022120600014698	寒锐钴业	2022年12月06日	44,600.00	1,000.00	14	3.40	58.97	-	-
东方证券	2022120600014724	宁德时代	2022年12月06日	400,020.00	1,000.00	14	3.40	528.92	-	-
东方证券	2022120600014732	汇川技术	2022年12月06日	71,450.00	1,000.00	14	3.40	94.47	-	-
东方证券	2022120600014760	赢合科技	2022年12月06日	20,380.00	1,000.00	14	3.40	26.95	-	-
东方证券	2022120600014766	特锐德	2022年12月06日	16,480.00	1,000.00	14	3.40	21.79	-	-
东方证券	2022120600015180	翔丰华	2022年12月	50,140.00	1,000.00	14	3.70	72.15	-	-

			06 日							
东方 证券	20221206000 15688	当 升 科 技	20 22 年 12 月 06 日	62,810.00	1,000. 00	14	3. 40	83.05	-	-
东方 证券	20221206000 15690	天 华 超 净	20 22 年 12 月 06 日	62,100.00	1,000. 00	14	3. 60	86.94	-	-
东方 证券	20221206000 15692	天 华 超 净	20 22 年 12 月 06 日	62,100.00	1,000. 00	14	3. 60	86.94	-	-
东方 证券	20221206000 15756	震 裕 科 技	20 22 年 12 月 06 日	190,100.0 0	2,000. 00	14	3. 50	258.75	-	-
东方 证券	20221206000 15760	震 裕 科 技	20 22 年 12 月 06 日	95,050.00	1,000. 00	14	3. 50	129.37	-	-
东方 证券	20221206000 15774	亿 纬 锂 能	20 22 年 12 月 06 日	86,170.00	1,000. 00	14	3. 40	113.94	-	-

东方证券	2022122000017088	翔丰华	2022年12月20日	44,180.00	1,000.00	14	3.70	63.57	40,500.00	49.95
东方证券	2022122000017092	震裕科技	2022年12月20日	169,380.00	2,000.00	14	3.50	230.55	165,300.00	181.15
东方证券	2022122000017128	天华超净	2022年12月20日	58,880.00	1,000.00	14	3.60	82.43	55,880.00	64.77
东方证券	2022122000017130	天华超净	2022年12月20日	58,880.00	1,000.00	14	3.60	82.43	55,880.00	64.77
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	2021011900000392	寒锐钴业	2021年01月	1,699,660.00	17,000.00	14	5.00	3,304.89	-	-

			19 日							
东方 证券	20210202000 09097	寒 锐 钴 业	20 21 年 02 月 02 日	1,734,000 .00	17,000 .00	28	5. 00	3,853. 33	-	-
东 方 证 券	20210622000 00887	宁 德 时 代	20 21 年 06 月 22 日	12,606,44 0.00	28,000 .00	14	3. 40	16,668 .52	-	-
东 方 证 券	20210706000 12380	宁 德 时 代	20 21 年 07 月 06 日	14,426,44 0.00	28,000 .00	28	3. 40	19,074 .96	-	-

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
基金合同生效日 （2018 年 05 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金 份额	10,003,600.36	10,003,600.36
报告期间申购/买入总 份额	2,019,382.07	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-
减：报告期间赎回/卖 出总份额	-	-
报告期末持有的基金	12,022,982.43	10,003,600.36

份额		
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	0.35	0.29
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C		
项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
基金合同生效日 （2018 年 05 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总 份额	-	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-
减：报告期间赎回/卖 出总份额	-	-
报告期末持有的基金 份额	-	-
报告期末持有的基金 份额占基金总份额比 例（%）	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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

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

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联 方名 称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商 银行	752,651,855.76	2,980,694.22	942,879,323.14	2,324,966.43

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

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

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	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
301161	唯万密封	2022年09月06日	6个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	
301165	锐捷网络	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	
301176	逸豪新材	2022年09月21日	6个月	新股流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	
301227	森鹰窗业	2022年09月16日	6个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	
301231	荣信	2022年	6个月	新股	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	

	文化	08月31日	月	流通受限						
301265	华新环保	2022年12月08日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	
301277	新天地	2022年11月09日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股流通受限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	
301283	聚胶股份	2022年08月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	
301285	鸿日达	2022年09月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	
301290	东星医疗	2022年11月	6个月	新股流通	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	



		23 日		受 限						
301301	川 宁 生 物	2022 年 12 月 20 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	
301309	万 得 凯	2022 年 09 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	
301311	昆 船 智 能	2022 年 11 月 23 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	
301313	凡 拓 数 创	2022 年 09 月 22 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	
301316	慧 博 云 通	2022 年 09 月 29 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	
301319	唯 特 偶	2022 年 09 月 22 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	
301327	华 宝 新 能	2022 年 09 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	

301335	天元宠物	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40
301339	通行宝	2022年09月02日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67
301349	信德新材	2022年08月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60
301356	天振股份	2022年11月03日	6个月	新股流通受限	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62
301363	美好医疗	2022年09月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92
301366	一博科技	2022年09月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12
301367	怡和	2022年	6个月	新股	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94

	嘉业	10月21日	月	流通受限						
301368	丰立智能	2022年12月07日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	
301379	天山电子	2022年10月19日	6个月	新股流通受限	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股流通受限	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04	
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	
301396	宏景科技	2022年11月	6个月	新股流通	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	

		04 日		受 限						
301398	星 源 卓 镁	2022 年 12 月 08 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	
688084	晶 品 特 装	2022 年 12 月 01 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	60.98	74.73	1,875	114,337.50	140,118.75	
688143	长 盈 通 光 电	2022 年 12 月 01 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	35.67	42.66	1,938	69,128.46	82,675.08	
688184	帕 瓦 股 份	2022 年 09 月 09 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	51.88	33.82	4,358	226,093.04	147,387.56	
688376	美 埃 科 技	2022 年 11 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	29.19	28.49	3,713	108,382.47	105,783.37	
688409	富 创 精 密	2022 年 09 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	69.99	95.65	6,334	443,316.66	605,847.10	
688506	百 利 天 恒	2022 年 12 月 28 日	6 个 交 易 日	新 股 流 通 受 限	24.70	24.70	15,622	385,863.40	385,863.40	

688525	佰维存储	2022年12月23日	6个月	新股流通受限	13.99	15.27	4,614	64,549.86	70,455.78	
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	
7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：张）	期末估值总额

1	002812	恩捷股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	131.29	471,500	61,903,235.00
2	300390	天华超净	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	55.88	598,000	33,416,240.00
3	300450	先导智能	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	40.25	829,600	33,391,400.00
4	300568	星源材质	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	21.26	1,388,000	29,508,880.00
5	600884	杉杉股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 05 日	18.20	1,160,000	21,112,000.00
6	300769	德方纳米	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	229.59	89,600	20,571,264.00
7	688005	容百科技	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	68.75	286,400	19,690,000.00
8	600580	卧龙电驱	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.46	1,123,900	14,003,794.00
9	688518	联赢激光股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	29.21	437,000	12,764,770.00
10	002518	科士达	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	57.60	214,500	12,355,200.00
11	300919	中伟	2023 年 01	-	2023 年 01	65.61	188,000	12,334,680.00

		股份	月 03	月 13				
			日	日				
12	688559	海目星激光	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	57.84	172,100	9,954,264.00
13	002340	格林美	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	7.43	1,000,000	7,430,000.00
14	603026	胜华新材	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	92.30	80,000	7,384,000.00
15	300693	盛弘股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	54.28	125,000	6,785,000.00
16	002497	雅化集团	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	23.25	275,000	6,393,750.00
17	603032	德新科技	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	87.76	66,400	5,827,264.00
18	300953	震裕科技	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	82.65	69,600	5,752,440.00
19	688388	嘉元科技	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	44.85	123,700	5,547,945.00
20	000762	西藏矿业	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	38.61	141,500	5,463,315.00
21	300681	英搏尔	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	39.61	134,500	5,327,545.00
22	688006	浙	2023	-	2023	43.77	111,400	4,875,978.00

		江杭可科技	年01月03日	年01月09日			
23	688148	芳源股份	2023年01月03日	2023年01月03日	14.59	332,700	4,854,093.00
24	688733	壹石通	2023年01月03日	2023年01月09日	37.67	121,300	4,569,371.00
25	688339	亿华通科技	2023年01月03日	2023年01月09日	74.00	54,100	4,003,400.00
26	300745	欣锐科技	2023年01月03日	2023年01月09日	37.84	105,100	3,976,984.00
27	688567	孚能科技	2023年01月09日	2023年01月09日	27.03	100,000	2,703,000.00
28	300890	翔丰华	2023年01月03日	2023年01月09日	40.50	64,600	2,616,300.00
29	002240	盛新锂能	2023年01月03日	2023年01月09日	37.49	66,500	2,493,085.00
30	002850	科达利	2023年01月03日	2023年01月09日	118.81	20,000	2,376,200.00
31	300432	富临精工	2023年01月03日	2023年01月03日	14.43	151,500	2,186,145.00
32	300457	赢合	2023年01月	2023年01月	17.67	118,000	2,085,060.00



		科技	月03日	月09日			
33	688707	振华新材料	2023年01月09日	2023年01月09日	44.95	44,200	1,986,790.00
34	688155	先惠技术	2023年01月03日	2023年01月03日	52.29	33,200	1,736,028.00
35	603906	龙蟠科技	2023年01月03日	2023年01月03日	23.15	68,800	1,592,720.00
36	300001	特锐德	2023年01月06日	2023年01月06日	15.21	100,000	1,521,000.00
37	300409	道氏技术	2023年01月03日	2023年01月09日	14.69	75,200	1,104,688.00
38	002126	银轮股份	2023年01月03日	2023年01月03日	12.41	85,500	1,061,055.00
39	300648	星云股份	2023年01月03日	2023年01月03日	37.02	28,000	1,036,560.00
40	002192	融捷股份	2023年01月03日	2023年01月03日	97.90	10,000	979,000.00
41	603659	璞泰来	2023年01月03日	2023年01月03日	51.89	16,300	845,807.00
42	300035	中科电气	2023年01月03日	2023年01月03日	20.58	24,200	498,036.00
43	002709	天	2023	2023	43.86	10,000	438,600.00

		赐 材 料	年 01 月 03 日	年 01 月 03 日			
44	600110	诺 德 股 份	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.95	20,300	161,385.00
合 计	-	-	-	-	-	10,735,200	386,618,271.00

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

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.3 流动性风险

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

### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1- 3 个月	3 个月 -1 年	1- 5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	752,651,855.76	-	-	-	-	-	752,651,855.76
结算备付金	3,316,875.68	-	-	-	-	-	3,316,875.68
存出保证金	742,696.12	-	-	-	-	-	742,696.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	12,756,678,122.47	12,756,678,122.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	569,290.17	-	-	-	-	18,248,123.93	18,817,414.10
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	320,025.83	320,025.83

资产总计	757,280,717.73	-	-	-	-	12,775,246,272.23	13,532,526,989.96
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	38.40	38.40
应付赎回款	-	-	-	-	-	24,073,021.20	24,073,021.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,988,225.91	11,988,225.91
应付托管费	-	-	-	-	-	1,198,822.57	1,198,822.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,290,867.07	1,290,867.07
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	30,357.14	30,357.14
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得	-	-	-	-	-	-	-

税负债							
其他负债	-	-	-	-	-	2,994,341.80	2,994,341.80
负债总计	-	-	-	-	-	41,575,674.09	41,575,674.09
利率敏感 度缺口	757,280,717.73	-	-	-	-	12,733,670,598.14	13,490,951,315.87
上年度末 2021年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	942,879,323.14	-	-	-	-	-	942,879,323.14
结算备付金	15,576,085.07	-	-	-	-	-	15,576,085.07
存出保证金	2,984,497.17	-	-	-	-	-	2,984,497.17
交易性金融资产	-	-	-	-	-	16,740,496,662.33	16,740,496,662.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	3,756,806.76	3,756,806.76
应收	-	-	-	-	-	-	-

股利							
应收 申购 款	14,688,298.15	-	-	-	-	84,535,759.53	99,224,057.68
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	203,369.25	203,369.25
资产 总计	976,128,203.53	-	-	-	-	16,828,992,597.87	17,805,120,801.40
负债							
短期 借款	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融负 债	-	-	-	-	-	-	-
衍生 金融 负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出 回购 金融 资产 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	43,748,005.62	43,748,005.62
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	14,842,898.71	14,842,898.71
应付 托管 费	-	-	-	-	-	1,484,289.87	1,484,289.87
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	1,464,221.19	1,464,221.19

应付 投资 顾问 费		-	-	-	-	-	-	-
应交 税费		-	-	-	-	-	-	-
应付 利润		-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税负 债		-	-	-	-	-	-	-
其他 负债		-	-	-	-	-	7,871,212.77	7,871,212.77
负债 总计		-	-	-	-	-	69,410,628.16	69,410,628.16
利率 敏感 度缺 口	976,128,203.53	-	-	-	-	-	16,759,581,969.71	17,735,710,173.24

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
----	----------------------	-----------------------



	公允价值	占基金资产净 值比例（%）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	12,756,678,122.47	94.56	16,740,496,662.33	94.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	12,756,678,122.47	94.56	16,740,496,662.33	94.39

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证新能源汽车产业指数上涨 5%	640,150,217.53	841,650,014.92
	中证新能源汽车产业指数下跌 5%	-640,150,217.53	-841,650,014.92

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

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	12,754,584,651.86	16,737,465,097.84
第二层次	385,863.40	380,229.35
第三层次	1,707,607.21	2,651,335.14
合计	12,756,678,122.47	16,740,496,662.33

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,651,335.14	2,651,335.14
当期购买	-	1,637,542.83	1,637,542.83
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,651,335.14	2,651,335.14
当期利得或损失总额	-	70,064.38	70,064.38

其中：计入损益的利得或损失	-	70,064.38	70,064.38
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,707,607.21	1,707,607.21
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	70,064.38	70,064.38
项目	上年度可比同期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,216,570.66	3,216,570.66
当期购买	-	2,204,409.21	2,204,409.21
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,216,570.66	3,216,570.66
当期利得或损失总额	-	446,925.93	446,925.93
其中：计入损益的利得或损失	-	446,925.93	446,925.93
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,651,335.14	2,651,335.14
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	446,925.93	446,925.93

#### 7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均	与公允价

				值	值之间的 关系
限售股票	1,707,607.21	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.2127-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估 值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均 值	与公允价 值之间的 关系
限售股票	2,651,335.14	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1717-2.7417	负相关

#### 7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	12,756,678,122.47	94.27
	其中：股票	12,756,678,122.47	94.27
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	755,968,731.44	5.59
8	其他各项资产	19,880,136.05	0.15
9	合计	13,532,526,989.96	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 386,618,271.00 元，占期末基金资产净值比例 2.87%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	235,977,300.90	1.75
C	制造业	12,364,801,384.12	91.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	152,136,933.00	1.13
	合计	12,752,915,618.02	94.53

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,208,959.04	0.02
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	417,227.17	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	12,316.92	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	66,597.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	57,404.12	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,762,504.45	0.03

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	3,685,697	1,450,026,913.74	10.75
2	002594	比亚迪	5,490,363	1,410,858,580.11	10.46
3	300124	汇川技术	13,495,553	937,940,933.50	6.95
4	300014	亿纬锂	8,884,178	780,919,246.20	5.79

		能			
5	002466	天齐锂业	7,498,369	592,296,167.31	4.39
6	002460	赣锋锂业	8,184,251	568,887,287.01	4.22
7	603799	华友钴业	9,270,519	515,718,971.97	3.82
8	002812	恩捷股份	3,628,331	476,363,576.99	3.53
9	002709	天赐材料	8,383,322	367,692,502.92	2.73
10	300450	先导智能	7,950,516	320,008,269.00	2.37
11	002050	三花智控	13,139,555	278,821,357.10	2.07
12	603659	璞泰来	5,043,142	261,688,638.38	1.94
13	002340	格林美	34,799,900	258,563,257.00	1.92
14	300769	德方纳米	882,088	202,518,583.92	1.50
15	600885	宏发股份	5,652,362	188,845,414.42	1.40
16	002407	多氟多	5,190,721	172,954,823.72	1.28
17	002497	雅化集团	7,029,000	163,424,250.00	1.21
18	002240	盛新锂能	4,325,444	162,160,895.56	1.20
19	300073	当升科技	2,745,725	154,858,890.00	1.15
20	300037	新宙邦	3,521,678	153,087,342.66	1.13
21	000009	中国宝安	12,583,700	152,136,933.00	1.13
22	300568	星源材质	6,943,196	147,612,346.96	1.09
23	600563	法拉电子	914,834	146,263,659.92	1.08
24	002074	国轩高科	5,062,743	145,958,880.69	1.08
25	600884	杉杉股份	7,624,635	138,768,357.00	1.03
26	002192	融捷股份	1,407,600	137,804,040.00	1.02
27	688567	孚能科技	4,922,300	133,049,769.00	0.99

28	300390	天华超净	2,343,300	130,943,604.00	0.97
29	688005	容百科技	1,833,130	126,027,687.50	0.93
30	600549	厦门钨业	5,767,084	112,746,492.20	0.84
31	002850	科达利	946,955	112,507,723.55	0.83
32	688116	天奈科技	1,347,312	103,931,647.68	0.77
33	300035	中科电气	4,901,345	100,869,680.10	0.75
34	000762	西藏矿业	2,542,690	98,173,260.90	0.73
35	002518	科士达	1,578,700	90,933,120.00	0.67
36	603026	胜华新材	961,361	88,733,620.30	0.66
37	600699	均胜电子	5,840,432	82,058,069.60	0.61
38	600580	卧龙电驱	6,236,995	77,712,957.70	0.58
39	688779	长远锂科	5,229,100	76,292,569.00	0.57
40	300919	中伟股份	1,090,600	71,554,266.00	0.53
41	300432	富临精工	4,955,350	71,505,700.50	0.53
42	600110	诺德股份	8,517,350	67,712,932.50	0.50
43	600066	宇通客车	9,001,343	67,600,085.93	0.50
44	688707	振华新材料	1,500,700	67,456,465.00	0.50
45	300693	盛弘股份	1,190,896	64,641,834.88	0.48
46	688518	联赢激光股份	2,182,120	63,739,725.20	0.47
47	002126	银轮股份	4,294,200	53,291,022.00	0.40
48	603032	德新科技	569,844	50,009,509.44	0.37
49	688559	海目星激光	861,200	49,811,808.00	0.37
50	603906	龙蟠科	1,914,553	44,321,901.95	0.33



		技			
51	688499	广东利元亨	238,500	37,535,130.00	0.28
52	300457	赢合科技	2,112,641	37,330,366.47	0.28
53	300409	道氏技术	2,197,077	32,275,061.13	0.24
54	301219	腾远钴业	460,880	31,768,458.40	0.24
55	688733	壹石通	812,200	30,595,574.00	0.23
56	300618	寒锐钴业	734,269	29,407,473.45	0.22
57	300953	震裕科技	348,200	28,778,730.00	0.21
58	688388	嘉元科技	618,924	27,758,741.40	0.21
59	300681	英搏尔	673,120	26,662,283.20	0.20
60	688006	浙江杭可科技	576,535	25,234,936.95	0.19
61	688148	芳源股份	1,664,400	24,283,596.00	0.18
62	301238	瑞泰新材	993,800	22,350,562.00	0.17
63	688339	亿华通科技	270,799	20,039,126.00	0.15
64	300890	翔丰华	460,400	18,646,200.00	0.14
65	300745	欣锐科技	480,402	18,178,411.68	0.13
66	300001	特锐德	987,307	15,016,939.47	0.11
67	301150	中一科技	219,800	14,179,298.00	0.11
68	688155	先惠技术	166,234	8,692,375.86	0.06
69	300648	星云股份	140,200	5,190,204.00	0.04
70	002196	方正电机	540,900	3,926,934.00	0.03
71	002227	奥特迅	167,900	2,098,750.00	0.02
72	300742	越博动力	114,940	1,160,894.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688409	富创精密	6,334	605,847.10	0.00
2	688114	华大智造	5,336	592,882.96	0.00
3	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.00
4	688432	有研硅	20,044	265,382.56	0.00
5	301389	隆扬电子	12,690	230,780.34	0.00
6	688152	麒麟信安	892	152,442.80	0.00
7	688184	帕瓦股份	4,358	147,387.56	0.00
8	688084	晶品特装	1,875	140,118.75	0.00
9	301396	宏景科技	3,960	134,592.48	0.00
10	301379	天山电子	4,481	114,278.07	0.00
11	688376	美埃科技	3,713	105,783.37	0.00
12	688291	金橙子科技	3,961	103,619.76	0.00
13	688143	长盈通光电	1,938	82,675.08	0.00
14	688525	佰维存储	4,614	70,455.78	0.00
15	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
16	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
17	301231	荣信文化	2,744	57,404.12	0.00
18	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
19	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
20	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00

21	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
22	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
23	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
24	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
25	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
26	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
27	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
28	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
29	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
30	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
31	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
32	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
33	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
34	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
35	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
36	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
37	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
38	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
39	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
40	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
41	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
42	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
43	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
44	301368	丰立智	337	6,241.24	0.00

		能			
45	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
46	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
47	301316	慧博云通	359	5,140.88	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	648,394,001.34	3.66
2	002594	比亚迪	408,250,421.30	2.30
3	002497	雅化集团	250,680,430.03	1.41
4	002812	恩捷股份	220,011,417.90	1.24
5	603799	华友钴业	206,215,729.64	1.16
6	300390	天华超净	205,892,441.43	1.16
7	300014	亿纬锂能	205,887,474.29	1.16
8	300124	汇川技术	199,749,198.93	1.13
9	002709	天赐材料	193,879,178.81	1.09
10	002466	天齐锂业	190,495,667.92	1.07
11	002460	赣锋锂业	186,239,802.19	1.05
12	000762	西藏矿业	145,928,497.12	0.82
13	688518	联赢激光股份	138,628,067.30	0.78
14	688567	孚能科技	137,295,496.38	0.77
15	300919	中伟股份	131,559,950.56	0.74
16	300450	先导智能	108,215,819.49	0.61
17	002050	三花智控	104,157,585.69	0.59
18	002340	格林美	88,648,619.70	0.50
19	300769	德方纳米	87,048,739.03	0.49
20	002407	多氟多	84,201,926.85	0.47

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	002594	比亚迪	675,313,303.92	3.81
2	300750	宁德时代	267,449,465.38	1.51
3	002812	恩捷股份	256,580,425.16	1.45
4	603799	华友钴业	210,264,063.19	1.19
5	002466	天齐锂业	199,355,130.35	1.12
6	300124	汇川技术	196,483,073.84	1.11
7	002709	天赐材料	196,217,725.95	1.11
8	002460	赣锋锂业	189,603,070.16	1.07
9	002074	国轩高科	170,048,330.82	0.96
10	300014	亿纬锂能	153,658,323.81	0.87
11	000009	中国宝安	132,016,962.28	0.74
12	300450	先导智能	115,661,930.65	0.65
13	002050	三花智控	107,270,462.54	0.60
14	600733	北汽蓝谷	100,806,430.02	0.57
15	300568	星源材质	98,540,278.67	0.56
16	300769	德方纳米	96,028,752.91	0.54
17	603659	璞泰来	93,394,074.55	0.53
18	002340	格林美	90,569,043.59	0.51
19	688116	天奈科技	78,808,592.13	0.44
20	600884	杉杉股份	77,418,726.51	0.44

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,148,038,085.45
卖出股票收入（成交）总额	5,226,057,627.81

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江西赣锋锂业集团股份有限公司出现在报告期内受监管机构立案调查的情况；江西赣锋锂业集团股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	742,696.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,817,414.10
6	其他应收款	320,025.83
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,880,136.05

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002812	恩捷股份	61,903,235.00	0.46	转融通出借流通受限
2	300450	先导智能	33,391,400.00	0.25	转融通出借流通受限
3	002709	天赐材料	438,600.00	0.00	转融通出借流通受限

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688409	富创精密	605,847.10	0.00	新股流通受限
2	688506	百利天恒	385,863.40	0.00	新股流通受限
3	301389	隆扬电子	21,776.04	0.00	新股流通受限

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构				
			机构投资者		个人投资者		
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	

汇添富 中证新 能源汽 车产业 指数 (LOF) A	723,096	4,765.70	81,896,120.43	2.38	3,364,159,756.92	97.62
汇添富 中证新 能源汽 车产业 指数 (LOF) C	730,338	3,651.59	38,451,314.14	1.44	2,628,446,146.69	98.56
合计	1,453,434	4,205.87	120,347,434.57	1.97	5,992,605,903.61	98.03

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	易方达颐 and 绝对收益多策略混合型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	2,872,019.00	2.35
2	黄家周	2,211,001.00	1.81
3	北京银行股份有限公司—汇添富均衡增长三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	1,331,529.00	1.09
4	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—传统险—汇添富国寿股份成长股票传统可供出	1,064,370.00	0.87
5	孙毅蕾	1,044,008.00	0.86
6	苏巍巍	808,039.00	0.66
7	顾蓓君	750,000.00	0.61
8	南京盛泉恒元投资有限公司—盛泉恒元量化套利专项 84 号私募证券投资基金	698,700.00	0.57
9	朱卫民	680,000.00	0.56



10	曾国芳	652,800.00	0.53
汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	齐志华	1,009,289.00	3.65
2	张庆旭	398,200.00	1.44
3	王红云	355,263.00	1.29
4	黄卫忠	326,100.00	1.18
5	成汝翠	322,796.00	1.17
6	赵静	218,600.00	0.79
7	邵常红	212,617.00	0.77
8	上海恒豫投资管理中心（有限合伙）	203,169.00	0.74
9	黎子健	200,009.00	0.72
10	范东启	197,575.00	0.72

注：本基金为LOF基金，上表持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	5,831,615.97	0.17
	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	475,516.36	0.02
	合计	6,307,132.33	0.10

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	>100
	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）A	0~10
	汇添富中证新能源汽车产业指数（LOF）C	0
	合计	0~10

## 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额 总数	持有份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额 总数	发起份额占 基金总份额 比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	12,022,982.43	0.20	10,003,600.36	0.16	3 年
基金管理人高级管理人员	3,678,302.56	0.06	-	-	
基金经理等人员	38,278.61	0.00	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	2,590,551.16	0.04	-	-	
合计	18,330,114.76	0.30	10,003,600.36	0.16	

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富中证新能源汽车产业指 数（LOF）A	汇添富中证新能源汽车产业指 数（LOF）C
基金合同生效日 （2018年05月23 日）基金份额总额	310,738,440.50	431,457,611.74
本报告期期初基金份 额总额	3,493,479,146.75	2,334,624,123.39
本报告期基金总申购 份额	3,053,253,646.16	3,483,500,588.99
减：本报告期基金总 赎回份额	3,100,676,915.56	3,151,227,251.55
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	3,446,055,877.35	2,666,897,460.83

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2018 年 05 月 23 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币 100,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

管理人采取整改措施的情况	公司已完成整改并通过监管验收
其他	无

注：报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查、处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	2	2,713,720,930.85	23.92	1,968,113.56	23.94	
中泰证券	1	1,719,498,839.29	15.15	1,236,553.94	15.04	
国海证券	2	1,334,182,301.30	11.76	957,191.53	11.64	
国泰君安	1	1,263,490,509.43	11.14	911,138.63	11.08	
东方证券	4	899,778,681.91	7.93	691,771.07	8.41	
中信建投证券	1	700,516,983.68	6.17	504,385.83	6.13	
长江证券	1	648,856,341.80	5.72	467,958.42	5.69	
瑞银证券	2	421,456,237.54	3.71	301,977.17	3.67	
信达证券	1	394,432,435.32	3.48	282,355.73	3.43	
东北证券	2	210,744,103.41	1.86	151,382.37	1.84	
中信证券	2	209,893,009.86	1.85	150,800.55	1.83	
东吴	1	200,616,622.07	1.77	144,703.26	1.76	

证券						
中银国际	1	139,922,984.67	1.23	99,662.16	1.21	
长城证券	2	129,268,033.36	1.14	91,947.57	1.12	
申万宏源证券	1	106,676,636.54	0.94	76,278.50	0.93	
东兴证券	1	96,964,453.33	0.85	68,971.01	0.84	
兴业证券	1	63,932,273.22	0.56	45,609.85	0.55	
太平洋证券	2	61,589,872.66	0.54	43,808.98	0.53	
中金公司	2	26,161,085.68	0.23	24,363.95	0.30	
海通证券	1	4,622,462.63	0.04	3,286.94	0.04	
广发证券	1	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
恒泰证券	2	-	-	-	-	
华西证券	1	-	-	-	-	
平安证券	1	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

		(%)		比例 (%)		(%)		(%)
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	12,223,545.92	7.61	-	-	-	-	-	-
国海 证券	18,067,400.00	11.24	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2,998,170.00	1.87	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银 证券	52,505,425.10	32.67	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	13,799,222.24	8.59	-	-	-	-	-	-
中信 证券	21,030,211.69	13.09	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	3,000,555.00	1.87	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	11,999,883.00	7.47	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平 洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	25,069,202.00	15.60	-	-	-	-	-	-
海通	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。
- (4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况,作为增加或更换券商交易单元的依据。
- (5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定,投资总监审批。
- (6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成;更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。
- (7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用,基金会计应负责协助及时催缴。
- (8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定,同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 31 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 01 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 22 日
6	汇添富基金管理股份有限公司关于在直销中心开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 28 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 05 月 27 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第二季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 21 日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年中期报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 31 日
10	关于汇添富基金管理股份有限公司调整旗下部分基金线上直销系统申购起点金额的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 20 日
11	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2022 年 09 月 21 日
12	汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电	2022 年 09 月 21 日



	更新招募说明书（2022 年 9 月 21 日更新）	子披露网站	
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第三季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 26 日
14	关于汇添富基金管理股份有限公司调整旗下部分基金申购起点金额、最低赎回份额、最低保留份额及单笔最低转换份额的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 12 日
15	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 12 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）募集的文件；

2、《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）在规定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

### 13.3 查阅方式

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

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 03 月 31 日