

华夏国证半导体芯片交易型开放式指数  
证券投资基金  
2020 年年度报告  
2020 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇二一年三月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 20 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介 .....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	4
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	4
3.2 基金净值表现 .....	4
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	6
§4 管理人报告 .....	6
§5 托管人报告 .....	12
§6 审计报告 .....	12
§7 年度财务报表 .....	14
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
§8 投资组合报告 .....	112
8.1 期末基金资产组合情况.....	112
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	113
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	114
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	116
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	117
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 .....	117
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 .....	118
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 .....	118
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 .....	118
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	118
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	118
8.12 投资组合报告附注 .....	118
§9 基金份额持有人信息 .....	120
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	120
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	120
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 .....	120
§10 开放式基金份额变动 .....	121
§11 重大事件揭示 .....	121
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	125
§13 备查文件目录 .....	125

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏国证半导体芯片 ETF
场内简称	芯片 ETF
基金主代码	159995
交易代码	159995
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,571,763,006.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 2 月 10 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，衍生品投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即国证半导体芯片指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息 披 露 负 责 人	姓名	李彬
	联系 电 话	400-818-6666
	电子 邮 箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	021-60637111
传 真	010-63136700	021-60635778
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25号
办公地址	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮 政 编 码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联 网网址	www.chinaamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特 殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广 场二座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	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	2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,234,368,526.61
本期利润	1,703,889,026.52
加权平均基金份额本期利润	0.1090
本期加权平均净值利润率	9.44%
本期基金份额净值增长率	21.97%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	3,490,647,186.55
期末可供分配基金份额利润	0.1784
期末基金资产净值	23,872,163,797.39
期末基金份额净值	1.2197
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	21.97%

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

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

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

④本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.00%	1.99%	6.43%	2.00%	0.57%	-0.01%
过去六个月	3.60%	2.40%	3.04%	2.42%	0.56%	-0.02%
自基金合同生 效起至今	21.97%	2.77%	28.43%	2.94%	-6.46%	-0.17%

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

华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 1 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日)



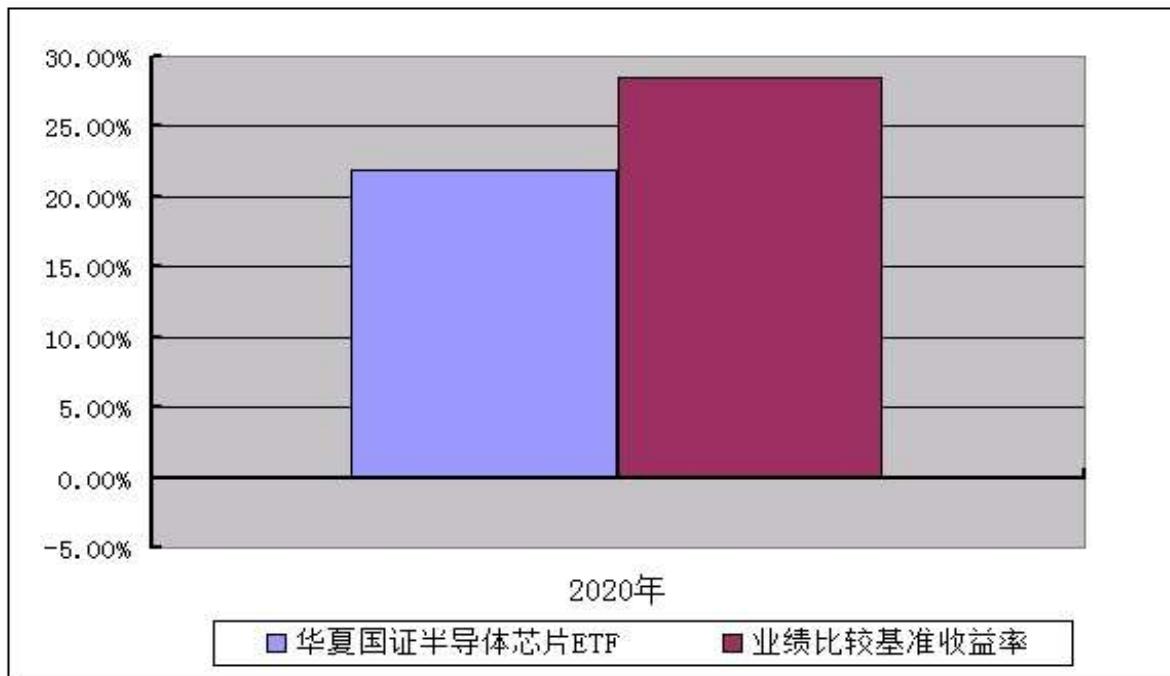
注：①本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效。

②根据本基金的基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

### 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

华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了

丰富的经验，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、华夏中证 500ETF、华夏中小板 ETF、华夏创业板 ETF、华夏上证科创板 50 成份 ETF、华夏中证央企 ETF、华夏中证四川国改 ETF、华夏中证浙江国资创新发展 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏中证 5G 通信主题 ETF、华夏中证人工智能主题 ETF、华夏国证半导体芯片 ETF、华夏中证新能源汽车 ETF、华夏粤港澳大湾区创新 100ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏中证细分食品饮料产业主题 ETF、华夏中证全指证券公司 ETF、华夏中证银行 ETF、华夏中证全指房地产 ETF、华夏创蓝筹 ETF、华夏创成长 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏恒生互联网科技业 ETF（QDII）、华夏野村日经 225ETF、华夏纳斯达克 100ETF（QDII）、华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF、华夏饲料豆粕期货 ETF 和华夏黄金 ETF，初步形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，2020 年，华夏基金旗下主要产品在基金分类排名中（数据截至 2020 年 12 月 31 日），华夏创新前沿股票在“股票基金-标准股票型基金-标准股票型基金（A 类）”中排序 21/201；华夏科技成长股票在“股票基金-行业主题股票型基金-TMT 与信息技术行业股票型基金（A 类）”中排序 3/10；华夏移动互联混合（QDII）和华夏新时代混合（QDII）在“QDII 基金-QDII 混合基金-QDII 混合基金（A 类）”中分别排序 4/34 和 2/34；华夏新兴消费混合在“混合基金-行业偏股型基金-消费行业偏股型基金（股票上下限 60%-95%）（A 类）”中排序 1/18；华夏稳健混合、华夏高端制造混合和华夏军工安全混合在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（A 类）”中分别排序 23/481、26/481 和 33/481；华夏消费升级混合 C 在“混合基金-灵活配置型基金-灵活配置型基金（股票上下限 0-95%+基准股票比例 30%-60%）（非 A 类）”中排序 12/215；华夏聚利债券（A）、华夏双债债券（A 类）及华夏债券（A 类）在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（可投转债）（A 类）”中分别排序 1/184、3/184 和 5/184；华夏鼎利债券（A 类）在“债券基金-普通债券型基金-普通债券型基金（二级）（A 类）”中排序 5/238；华夏鼎琪三个月定开债券在“债券基金-定期开放式纯债债券型基金-定期开放式纯债债券型基金（A 类）”中排序 5/334；华夏可转债增强债券（A 类）在“债券基金-可转换债券型基金-可转换债券型基金（A 类）”中排序 3/34；华夏鼎通债券在“债券基金-纯债债券型基金-长期纯债债券型基金（A 类）”中排序 31/499；华夏中证 AH 经济蓝筹股票指数（C 类）在“股票基金-标准指数股票型基金-标准策略指数股票型基金（非 A 类）”中排序 8/21；华夏创业板 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-规模指数股票 ETF 基金”中排序 1/78；华夏消费 ETF 及华夏医药 ETF 在“股票基金-股票 ETF

基金-行业指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/33 和 4/33；华夏能源革新股票在“股票基金-行业股票型基金-其他行业股票型基金”中排序 2/36；华夏战略新兴成指 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-主题指数股票 ETF 基金”中排序 5/52；华夏创成长 ETF 及华夏创蓝筹 ETF 在“股票基金-股票 ETF 基金-策略指数股票 ETF 基金”中分别排序 1/16 和 3/16；华夏创业板 ETF 联接及华夏中小板 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-规模指数股票 ETF 联接基金（A 类）”中分别排序 1/61 和 14/61；华夏战略新兴成指 ETF 联接在“股票基金-股票 ETF 联接基金-主题指数股票 ETF 联接基金（非 A 类）”中排序 2/18。

公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在中国证券报举办的第十七届中国基金业金牛奖评选活动中，华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”奖，华夏上证 50ETF 荣获“三年期开放式指数型持续优胜金牛基金”奖。在证券时报社主办，在晨星资讯、上海证券和济安金信提供数据和研究支持的第十五届中国基金业明星基金奖评选中，华夏基金荣获“ETF 管理明星基金公司”，华夏回报混合荣获“五年持续回报绝对收益策略明星基金”。

在客户服务方面，2020 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金管家客户端上线双周定投、日定投、部分基金定投止盈功能，丰富了投资者定期定额交易的投资形式；（2）华夏基金直销上线美元支付方式，为投资者使用美元交易提供便利；（3）华夏基金微信公众号上线货币基金收益播报推送功能，方便客户及时了解持有的货币基金收益变动情况；（4）与苏州农商银行、渤海银行、中天证券、华融融达等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（5）开展“凡是家人，都有户口本”、“以家人之名”、“牙掉了之后”、“2020 新鲜事”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宗庭	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2020-01-20	-	12 年	对外经济贸易大学经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。

					理。2016 年 11 月加入华夏基金 管理有限公司。
--	--	--	--	--	-----------------------------------

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金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 5% 的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为国证半导体芯片指数。国证半导体芯片指数反映 A 股市场芯片产业中业务范畴属于材料、设备、设计、制造、封装和测试相关上市公司的市场表现，截至 2020 年 12 月

31 日，国证半导体芯片指数成份股 30 只。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2020 年，是极为不平凡的一年，肆虐全球的新冠肺炎疫情给世界各国经济社会发展都造成严重冲击，产业链、供应链循环受阻，国际贸易投资萎缩，大宗商品市场动荡。为应对疫情带来的不利影响，各国政府实施积极的财政政策和宽松的货币政策，尤其是美联储开启了大规模的扩表，以期刺激经济恢复增长，全球经济总体呈现先抑后扬态势。国内方面，面对疫情巨大冲击和复杂严峻的国内外环境，中国率先控制住疫情、率先复工复产、率先实现经济正增长，经济呈现逐季好转、稳定恢复态势。2020 年国内生产总值达到 101.6 万亿元，经济总量迈上百万亿元的新台阶，“十三五”规划圆满收官；货币政策方面，中国央行继续实施稳健的货币政策，灵活适度、精准导向，没有采取量化宽松等非常规的货币政策措施。

市场方面，1 季度，全球股市表现不平静，境外成熟市场主要指数跌幅几乎都在 20% 左右，A 股指数则跌幅相对较小；2 季度，包括美国、日本、中国等在内的主要经济体股市从 3 月低谷反弹；3 季度，驱动全球股票市场表现的因素从货币、财政政策刺激转向疫情后复苏期的基本面变化，A 股进入了震荡阶段，市场关注焦点也逐渐从流动性驱动的题材类转向基本面驱动的周期类；4 季度，A 股市场开启了震荡向上走势。

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

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经深圳证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括中信证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、东兴证券股份有限公司、海通证券股份有限公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.2197 元，本报告期份额净值增长率为 21.97%，同期业绩比较基准增长率 28.43%。本基金本报告期跟踪偏离度为 -6.46%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，国际方面，部分国家已经宣布将出台规模庞大的财政支持，包括美国、日本公布的计划以及“欧盟下一代”复苏基金的推出，这些财政支持政策将进一步刺激发达国家经济复苏，并对贸易伙伴产生积极的溢出效应；由于美国、欧元区和日本的通胀预期仍低于市场一致预期，再叠加各国复苏之路并非都会一帆风顺而造成的全球经济不均衡复苏格局，各国央行料难以推动超宽松货币政策迅速回归正常化；IMF 预测全球经济将在 2021 年增长 5.5%，其中发达经济体增长 4.3%，

新兴及发展中经济体增长 6.3%。国内方面，2021 年是中国“十四五”规划和 2035 年远景目标的开局之年，支撑经济稳定恢复的有利因素较多，经济有基础也有条件延续稳健复苏态势，虽然当前疫情防控“外防输入、内防反弹”的压力仍然较大，但经济长期向好的基本面没有改变，并正在显现；总之，中国经济向常态回归，内生动能逐步增强，宏观形势总体向好，IMF 预测中国经济 2021 年将增长 8.1%，增速在全球来看仍然较为领先。

市场方面，随着疫情影响逐渐退去，各国货币政策预期将逐步有序地回归常态化，流动性不再成为推动估值上涨的重要因素，全球股票市场将回归基本面。中国 A 股市场也不例外，在货币政策仍然保持稳健的情况下，企业盈利增长将成为高估值板块修复估值以及低估值板块上涨的重要因素，预计全年区间震荡，但仍有结构性机会，总体上大势并不悲观。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司持续完善合规管理制度建设，修订了合规风险管理制度，对各层级的合规管理职责、合规考核、奖惩、履职保障等方面进行完善，进一步健全了合规管理机制；修订了内幕交易防控制度，强化了投资交易重点领域的合规风险防控；制定了基金参与重大关联交易管理制度，确保基金投资操作符合法律法规和监管要求。对发现的基金投资交易过程中的合规风险进行提示，对遇到的合规问题进行研究分析，充分评估给予合规意见，把控合规风险。公司开展多种形式的法律法规和职业道德培训，通过法律法规和案例讲解，不断加深员工的理解，强化合规意识，促进廉洁从业。公司严格落实信息披露新规要求，按期完成基金产品资料概要披露工作，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理体系建设，稳步夯实投资风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，对资产管理计划业务和分支机构业务进行检查监督，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况真实、准确。

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

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

### §6 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 23893 号

华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 6.1 审计意见

##### (1) 我们审计的内容

我们审计了华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏国证半导体芯片 ETF 基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

##### (2) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了华夏国证半导体芯片 ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏国证半导体芯片 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

#### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

基金管理人治理层负责监督华夏国证半导体芯片 ETF 基金的财务报告过程。

#### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出

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

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

(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。

(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。

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

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

(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。

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

单峰 程红粤

上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	97,894,089.73
结算备付金		36,249,027.33
存出保证金		3,957,892.09
交易性金融资产	7.4.7.2	23,840,730,771.20
其中：股票投资		23,825,437,771.20
基金投资		-
债券投资		15,293,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		28,194,014.67
应收利息	7.4.7.5	1,187,336.54
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		24,008,213,131.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		9,937,717.35
应付托管费		1,987,543.47
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	16,460,904.87
应交税费		71,892.72
应付利息		-
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	107,591,275.76
负债合计		136,049,334.17
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	19,571,763,006.00
未分配利润	7.4.7.10	4,300,400,791.39
所有者权益合计		23,872,163,797.39
负债和所有者权益总计		24,008,213,131.56

注:①报告截止日 2020 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.2197 元,基金份额总额 19,571,763,006.00 份。

②本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效,本报告期自 2020 年 1 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体: 华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2020 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		1,927,413,769.65
1.利息收入		13,233,083.06
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	3,453,428.69
债券利息收入		2,083.25
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,378,622.55
证券出借利息收入		7,398,948.57
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,279,908,612.48
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	1,249,726,456.69
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	318,369.03
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	29,863,786.76
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	469,520,499.91
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	164,751,574.20
<b>减: 二、费用</b>		223,524,743.13
1.管理人报酬		84,338,832.65

2. 托管费		16,867,766.50
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.20	117,004,240.52
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		22,204.11
7. 其他费用	7.4.7.21	5,291,699.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,703,889,026.52
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,703,889,026.52

注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，本报告期自 2020 年 1 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	实收基金	未分配利润
一、期初所有者权益（基金净值）	5,388,463,006.00	-	5,388,463,006.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,703,889,026.52	1,703,889,026.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	14,183,300,000.00	2,596,511,764.87	16,779,811,764.87
其中：1. 基金申购款	92,017,000,000.00	13,809,789,024.48	105,826,789,024.48
2. 基金赎回款	-77,833,700,000.00	-11,213,277,259.61	-89,046,977,259.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	19,571,763,006.00	4,300,400,791.39	23,872,163,797.39

注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，本报告期自 2020 年 1 月 20 日至 2020 年 12 月 31 日。

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：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019] 2662 号《关于准予华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金管理办法》、《华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2019 年 12 月 24 日至 2020 年 1 月 14 日共募集 5,388,033,992.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 60739337\_A04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,388,463,006.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 429,014.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

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

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

###### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，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平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 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

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司

司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- (2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。
- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- (4) 存款利息收入不征收增值税。
- (5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- (6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。
- (9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定

缴纳印花税。

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

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 5%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	97,894,089.73
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	97,894,089.73

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,355,917,271.29	23,825,437,771.20	469,520,499.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	15,293,000.00	15,293,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	15,293,000.00	15,293,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	23,371,210,271.29	23,840,730,771.20	469,520,499.91

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 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

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	14,344.19
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	18,097.27
应收债券利息	268.15
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	1,152,667.83
其他	1,959.10
合计	1,187,336.54

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	16,460,904.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	16,460,904.87

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

预提费用	200,000.00
应付指数使用费	3,239,101.57
应退替代款	103,653,568.79
可退替代款	498,605.40
合计	107,591,275.76

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,388,463,006.00	5,388,463,006.00
本期申购	92,017,000,000.00	92,017,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-77,833,700,000.00	-77,833,700,000.00
本期末	19,571,763,006.00	19,571,763,006.00

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 5,388,033,992.00 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 429,014.00 元在本基金合同生效后，折算为 429,014.00 份基金份额，计入基金份额持有者账户。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,234,368,526.61	469,520,499.91	1,703,889,026.52
本期基金份额交易产生的变动数	2,256,278,659.94	340,233,104.93	2,596,511,764.87
其中：基金申购款	8,847,638,898.61	4,962,150,125.87	13,809,789,024.48
基金赎回款	-6,591,360,238.67	-4,621,917,020.94	-11,213,277,259.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,490,647,186.55	809,753,604.84	4,300,400,791.39

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
活期存款利息收入		2,402,460.10
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		986,444.51
其他		64,524.08
合计		3,453,428.69

#### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月 31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-707,988,605.40
股票投资收益——赎回差价收入	1,957,715,062.09
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,249,726,456.69

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31 日
卖出股票成交总额	53,329,980,237.12
减：卖出股票成本总额	54,037,968,842.52
买卖股票差价收入	-707,988,605.40

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月 31日
赎回基金份额对价总额	89,046,977,259.61
减：现金支付赎回款总额	47,938,852,716.61
减：赎回股票成本总额	39,150,409,480.91
赎回差价收入	1,957,715,062.09

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,917,246.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	13,597,000.00

本总额	
减：应收利息总额	1,877.50
买卖债券差价收入	318,369.03

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

#### 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

无。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	29,863,786.76
其中：证券出借权益补偿收入	116,026.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	29,863,786.76

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	469,520,499.91
——股票投资	469,520,499.91
——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	-
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	469,520,499.91

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	164,699,750.81
其他	51,823.39
合计	164,751,574.20

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	117,004,240.52
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	117,004,240.52

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	30,969.38
指数使用费	5,060,329.97
其他	400.00
合计	5,291,699.35

## 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，本基金无资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基 金发起式联接基金（“华夏国证半导体芯片 ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	52,800,852,421.51	43.18%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020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

中信证券	22,774,924.30	43.18%	4,242,413.42	25.77%
------	---------------	--------	--------------	--------

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
	2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	84,338,832.65

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

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	16,867,766.50

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

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

##### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

单位：人民币元

关联方名称	交易金额	利息收入	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
			期末证券出借 业务余额	期末应收利息 余额
中信证券	1,397,781,196.00	1,576,520.29	332,508,630.00	385,581.40

###### 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

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： )	出借期限 (单位： ： )	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
									本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
中信证券	2020072300000 418	扬杰科技	2020-07-23	1,399,274.00	43,700.00	14	1.70	925.08	-	-
中信证券	2020072800000 588	上海新阳	2020-07-28	599,900.00	10,000.00	14	1.70	396.60	-	-
中信证券	2020080400000 523	飞凯材料	2020-08-04	890,050.00	35,000.00	14	1.70	588.42	-	-
中信证券	2020080600000 612	鼎龙股份	2020-08-06	1,767,248.00	86,800.00	14	1.70	1,168.35	-	-
中信证券	2020080600002 267	扬杰科技	2020-08-06	1,404,518.00	43,700.00	14	1.70	928.54	-	-
中信证券	2020081100005 523	上海新阳	2020-08-11	608,000.00	10,000.00	14	1.70	401.96	-	-
中信证券	2020081100010 430	上海新阳	2020-08-11	1,200.00	-	14	1.70	-	-	-
中信证	2020081300000 724	飞凯材	2020-08-13	333,905.00	14,300.00	14	1.70	220.75	-	-

券		料							
中 信 证 券	2020081300000 742	卓 胜 微	2020-08- 13	4,068,600.00	10,000.00	14	1.70	2,689.80	- -
中 信 证 券	2020081300004 403	鼎 龙 股 份	2020-08- 06	1,752.42	-	14	1.70	-	- -
中 信 证 券	2020081800000 617	扬 杰 科 技	2020-08- 18	654,600.00	20,000.00	14	1.70	432.76	- -
中 信 证 券	2020081800000 631	全 志 科 技	2020-08- 18	388,300.00	10,000.00	14	1.70	256.71	- -
中 信 证 券	2020081800000 640	景 嘉 微	2020-08- 18	2,505,000.00	30,000.00	28	1.80	3,507.00	- -
中 信 证 券	2020082000003 182	扬 杰 科 技	2020-08- 20	1,343,775.00	43,700.00	14	1.70	888.38	- -
中 信 证 券	2020082000003 184	鼎 龙 股 份	2020-08- 20	1,494,696.00	86,800.00	14	1.70	988.16	- -
中 信 证 券	2020082500008 935	上 海 新 阳	2020-08- 25	610,700.00	10,000.00	14	1.70	403.74	- -
中 信 证 券	2020082700002 859	飞 凯 材 料	2020-08- 27	311,597.00	14,300.00	14	1.70	206.00	- -
中 信 证 券	2020082700002 869	卓 胜 微	2020-08- 27	3,995,300.00	10,000.00	14	1.70	2,641.34	- -
中 信 证 券	2020090100000 466	卓 胜 微	2020-09- 01	5,873,517.00	15,300.00	14	3.60	8,222.92	- -

券									
中 信 证 券	2020090100004 457	扬 杰 科 技	2020-09- 01	635,400.00	20,000.00	14	3.20	790.72	- -
中 信 证 券	2020090300005 504	扬 杰 科 技	2020-09- 03	1,369,121.00	43,700.00	14	3.20	1,703.80	- -
中 信 证 券	2020090300005 506	鼎 龙 股 份	2020-09- 03	1,554,588.00	86,800.00	14	3.20	1,934.60	- -
中 信 证 券	2020090800000 337	扬 杰 科 技	2020-09- 08	1,838,000.00	50,000.00	14	3.40	2,430.24	- -
中 信 证 券	2020090800005 917	上 海 新 阳	2020-09- 08	530,300.00	10,000.00	14	3.50	721.80	- -
中 信 证 券	2020091000000 524	鼎 龙 股 份	2020-09- 10	1,279,200.00	82,000.00	28	3.40	3,503.58	- -
中 信 证 券	2020091000000 532	晶 盛 机 电	2020-09- 10	1,069,600.00	40,000.00	14	3.50	1,455.84	- -
中 信 证 券	2020091000000 538	全 志 科 技	2020-09- 10	1,024,335.00	30,900.00	28	3.40	2,805.54	- -
中 信 证 券	2020091000000 540	景 嘉 微	2020-09- 10	2,217,315.00	34,500.00	28	3.40	6,072.98	- -
中 信 证 券	2020091000004 669	飞 凯 材 料	2020-09- 10	277,134.00	14,300.00	14	3.50	377.21	- -
中 信 证 券	2020091000004 671	卓 胜 微	2020-09- 10	3,317,100.00	10,000.00	14	3.50	4,514.94	- -

券										
中 信 证 券	2020091500000 416	晶 盛 机 电	2020-09- 15	1,834,200.00	60,000.00	14	3.50	2,496.55	-	-
中 信 证 券	2020091500000 422	景 嘉 微	2020-09- 15	659,900.00	10,000.00	14	3.50	898.20	-	-
中 信 证 券	2020091500003 898	景 嘉 微	2020-09- 15	1,979,700.00	30,000.00	28	3.40	5,235.21	-	-
中 信 证 券	2020091500003 900	卓 胜 微	2020-09- 15	5,629,635.00	15,300.00	14	3.50	7,662.56	-	-
中 信 证 券	2020091500003 912	扬 杰 科 技	2020-09- 15	835,600.00	20,000.00	14	3.40	1,104.85	-	-
中 信 证 券	2020091700000 491	晶 盛 机 电	2020-09- 17	4,587,800.00	140,000.0 0	14	3.50	9,812.80	-	-
中 信 证 券	2020091700004 430	扬 杰 科 技	2020-09- 17	1,892,210.00	43,700.00	14	3.40	3,931.59	-	-
中 信 证 券	2020091700004 434	鼎 龙 股 份	2020-09- 17	1,436,540.00	86,800.00	14	3.50	3,072.60	-	-
中 信 证 券	2020092200006 923	上 海 新 阳	2020-09- 22	529,000.00	10,000.00	14	3.60	899.30	-	-
中 信 证 券	2020092200006 927	扬 杰 科 技	2020-09- 22	1,940,000.00	50,000.00	14	3.50	3,206.39	-	-
中 信 证 券	2020092400000 340	扬 杰 科	2020-09- 24	3,679,769.00	92,900.00	14	3.60	5,519.66	-	-

券		技							
中 信 证 券	2020092400000 354	晶 盛 机 电	2020-09- 24	937,440.00	31,000.00	28	3.60	2,624.83	- -
中 信 证 券	2020092400003 708	卓 胜 微	2020-09- 24	3,800,100.00	10,000.00	14	3.50	5,541.81	- -
中 信 证 券	2020092400003 728	飞 凯 材 料	2020-09- 24	310,739.00	14,300.00	14	3.60	466.10	- -
中 信 证 券	2020092400003 730	晶 盛 机 电	2020-09- 24	1,209,600.00	40,000.00	14	3.50	1,764.00	- -
中 信 证 券	2020092900004 475	卓 胜 微	2020-09- 29	5,615,406.00	15,300.00	14	3.70	8,079.95	- -
中 信 证 券	2020092900004 479	景 嘉 微	2020-09- 29	638,000.00	10,000.00	14	3.70	918.01	- -
中 信 证 券	2020092900005 025	扬 杰 科 技	2020-09- 29	853,600.00	20,000.00	14	3.60	1,195.04	- -
中 信 证 券	2020092900005 029	晶 盛 机 电	2020-09- 29	1,812,000.00	60,000.00	14	3.70	2,607.27	- -
中 信 证 券	2020100900033 273	全 志 科 技	2020-10- 09	1,045,656.00	30,900.00	28	3.40	2,765.18	- -
中 信 证 券	2020100900033 277	上 海 新 阳	2020-10- 09	527,000.00	10,000.00	14	3.70	758.29	- -
中 信 证 券	2020100900033 279	景 嘉 微	2020-10- 09	2,218,350.00	34,500.00	28	3.60	6,211.38	- -

券									
中 信 证 券	2020100900033 283	鼎 龙 股 份	2020-10-09	1,436,540.00	86,800.00	14	3.50	1,955.29	- -
中 信 证 券	2020100900033 285	鼎 龙 股 份	2020-10-09	1,357,100.00	82,000.00	28	3.40	3,588.78	- -
中 信 证 券	2020100900033 289	扬 杰 科 技	2020-10-09	2,189,000.00	50,000.00	14	3.60	3,064.60	- -
中 信 证 券	2020100900033 291	扬 杰 科 技	2020-10-09	1,913,186.00	43,700.00	14	3.60	2,678.46	- -
中 信 证 券	2020100900033 295	晶 盛 机 电	2020-10-09	4,468,800.00	140,000.00	14	3.70	6,430.11	- -
中 信 证 券	2020100900034 781	晶 盛 机 电	2020-10-09	1,276,800.00	40,000.00	14	3.70	1,837.17	- -
中 信 证 券	2020100900034 783	扬 杰 科 技	2020-10-09	4,067,162.00	92,900.00	14	3.60	5,694.03	- -
中 信 证 券	2020100900034 789	飞 凯 材 料	2020-10-09	321,321.00	14,300.00	14	3.50	437.35	- -
中 信 证 券	2020100900034 797	卓 胜 微	2020-10-09	3,938,200.00	10,000.00	14	3.70	5,666.63	- -
中 信 证 券	2020101300000 735	晶 盛 机 电	2020-10-13	2,065,200.00	60,000.00	14	3.50	2,810.97	- -
中 信 证 券	2020101300000 737	卓 胜 微	2020-10-13	7,226,530.00	17,000.00	14	3.50	9,836.11	- -

券									
中 信 证 券	2020101300000 743	扬 杰 科 技	2020-10- 13	2,697,000.00	60,000.00	14	3.60	3,775.80	- -
中 信 证 券	2020101300007 408	卓 胜 微	2020-10- 13	6,503,877.00	15,300.00	14	3.70	9,358.36	- -
中 信 证 券	2020101300007 424	景 嘉 微	2020-10- 13	2,002,200.00	30,000.00	28	3.60	5,606.16	- -
中 信 证 券	2020101300007 496	扬 杰 科 技	2020-10- 13	899,000.00	20,000.00	14	3.60	1,258.60	- -
中 信 证 券	2020101300007 498	景 嘉 微	2020-10- 13	667,400.00	10,000.00	14	3.60	934.36	- -
中 信 证 券	2020101300007 502	晶 盛 机 电	2020-10- 13	2,065,200.00	60,000.00	14	3.70	2,971.59	- -
中 信 证 券	2020101500000 540	卓 胜 微	2020-10- 15	5,586,000.00	13,300.00	14	3.50	7,603.17	- -
中 信 证 券	2020101500000 542	全 志 科 技	2020-10- 15	336,700.00	10,000.00	14	3.50	458.29	- -
中 信 证 券	2020101500000 544	晶 盛 机 电	2020-10- 15	6,584,000.00	200,000.0 0	14	3.50	8,961.56	- -
中 信 证 券	2020102000000 464	鼎 龙 股 份	2020-10- 20	196,320.00	12,000.00	14	3.50	267.21	- -
中 信 证 券	2020102000000 466	卓 胜 微	2020-10- 20	4,250,000.00	10,000.00	14	3.60	5,950.00	- -

券									
中 信 证 券	2020102000000 480	扬 杰 科 技	2020-10- 20	1,646,400.00	40,000.00	14	3.70	2,368.99	- -
中 信 证 券	2020102000000 488	晶 盛 机 电	2020-10- 20	1,324,894.00	43,100.00	14	3.60	1,854.85	- -
中 信 证 券	2020102200003 597	晶 盛 机 电	2020-10- 22	902,100.00	31,000.00	28	3.40	2,385.55	- -
中 信 证 券	2020102300026 380	扬 杰 科 技	2020-10- 23	1,662,785.00	43,700.00	14	3.60	2,327.90	- -
中 信 证 券	2020102300026 382	扬 杰 科 技	2020-10- 23	1,902,500.00	50,000.00	14	3.60	2,663.50	- -
中 信 证 券	2020102300026 384	卓 胜 微	2020-10- 23	3,909,000.00	10,000.00	14	3.50	5,320.58	- -
中 信 证 券	2020102300026 386	上 海 新 阳	2020-10- 23	486,900.00	10,000.00	14	3.50	662.73	- -
中 信 证 券	2020102300026 388	鼎 龙 股 份	2020-10- 23	1,334,984.00	86,800.00	14	3.50	1,817.06	- -
中 信 证 券	2020102300026 390	晶 盛 机 电	2020-10- 23	3,963,400.00	140,000.0 0	14	3.50	5,394.63	- -
中 信 证 券	2020102300026 392	晶 盛 机 电	2020-10- 23	1,132,400.00	40,000.00	14	3.50	1,541.32	- -
中 信 证 券	2020102300026 394	飞 凯 材	2020-10- 23	286,572.00	14,300.00	14	3.50	390.06	- -

券		料							
中 信 证 券	2020102300026 396	扬 杰 科 技	2020-10- 23	3,534,845.00	92,900.00	14	3.60	4,948.78	- -
中 信 证 券	2020102700009 158	景 嘉 微	2020-10- 27	611,000.00	10,000.00	14	3.60	855.40	- -
中 信 证 券	2020102700009 160	扬 杰 科 技	2020-10- 27	772,000.00	20,000.00	14	3.70	1,110.82	- -
中 信 证 券	2020102700009 162	扬 杰 科 技	2020-10- 27	2,316,000.00	60,000.00	14	3.70	3,332.47	- -
中 信 证 券	2020102700009 164	晶 盛 机 电	2020-10- 27	1,744,800.00	60,000.00	14	3.60	2,442.72	- -
中 信 证 券	2020102700009 166	卓 胜 微	2020-10- 27	6,431,049.00	15,300.00	14	3.60	9,003.47	- -
中 信 证 券	2020102700009 168	晶 盛 机 电	2020-10- 27	1,744,800.00	60,000.00	14	3.60	2,442.72	- -
中 信 证 券	2020102700009 170	卓 胜 微	2020-10- 27	7,145,610.00	17,000.00	14	3.60	10,003.85	- -
中 信 证 券	2020102900002 316	全 志 科 技	2020-10- 29	331,000.00	10,000.00	14	3.50	450.53	- -
中 信 证 券	2020102900002 318	卓 胜 微	2020-10- 29	5,689,740.00	13,300.00	14	3.60	7,965.64	- -
中 信 证 券	2020102900002 320	晶 盛 机	2020-10- 29	5,906,000.00	200,000.0 0	14	3.60	8,268.40	- -

券		电							
中 信 证 券	2020110300003 144	扬 杰 科 技	2020-11- 03	1,698,800.00	40,000.00	14	3.70	2,444.38	- -
中 信 证 券	2020110300003 146	晶 盛 机 电	2020-11- 03	1,294,293.00	43,100.00	14	3.60	1,812.01	- -
中 信 证 券	2020110300003 148	鼎 龙 股 份	2020-11- 03	181,680.00	12,000.00	14	3.60	254.35	- -
中 信 证 券	2020110600028 315	飞 凯 材 料	2020-11- 06	269,555.00	14,300.00	14	3.60	377.38	- -
中 信 证 券	2020110600028 699	扬 杰 科 技	2020-11- 06	3,933,386.00	92,900.00	14	3.70	5,659.71	- -
中 信 证 券	2020110600028 703	扬 杰 科 技	2020-11- 06	1,850,258.00	43,700.00	14	3.70	2,662.32	- -
中 信 证 券	2020110600028 725	卓 胜 微	2020-11- 06	4,830,000.00	10,000.00	14	3.50	6,574.17	- -
中 信 证 券	2020110600030 249	上 海 新 阳	2020-11- 06	554,000.00	10,000.00	14	3.40	732.51	- -
中 信 证 券	2020110600030 251	鼎 龙 股 份	2020-11- 06	1,262,072.00	86,800.00	14	3.60	1,766.90	- -
中 信 证 券	2020110600030 253	晶 盛 机 电	2020-11- 06	4,209,800.00	140,000.0 0	14	3.60	5,893.72	- -
中 信 证 券	2020110600030 261	晶 盛 机	2020-11- 06	1,202,800.00	40,000.00	14	3.60	1,683.92	- -

券		电							
中 信 证 券	2020110600030 271	全 志 科 技	2020-11-06	1,108,383.00	30,900.00	28	3.20	2,758.64	- -
中 信 证 券	2020110600030 275	景 嘉 微	2020-11-06	2,163,150.00	34,500.00	28	3.40	5,720.33	- -
中 信 证 券	2020110600030 279	扬 杰 科 技	2020-11-06	2,117,000.00	50,000.00	14	3.70	3,046.13	- -
中 信 证 券	2020111000009 009	晶 盛 机 电	2020-11-10	1,927,200.00	60,000.00	14	3.50	2,623.13	- -
中 信 证 券	2020111000009 011	扬 杰 科 技	2020-11-10	960,400.00	20,000.00	14	3.70	1,381.91	- -
中 信 证 券	2020111000009 013	晶 盛 机 电	2020-11-10	1,927,200.00	60,000.00	14	3.50	2,623.13	- -
中 信 证 券	2020111000009 015	扬 杰 科 技	2020-11-10	2,881,200.00	60,000.00	14	3.70	4,145.73	- -
中 信 证 券	2020111000009 017	景 嘉 微	2020-11-10	640,400.00	10,000.00	14	3.50	871.66	- -
中 信 证 券	2020111000009 019	景 嘉 微	2020-11-10	1,921,200.00	30,000.00	28	3.40	5,080.51	- -
中 信 证 券	2020111000009 021	卓 胜 微	2020-11-10	9,146,000.00	17,000.00	14	3.90	13,871.43	- -
中 信 证 券	2020111200004 277	全 志 科	2020-11-12	348,600.00	10,000.00	14	3.40	460.93	- -

券		技							
中 信 证 券	2020111200004 279	晶 盛 机 电	2020-11- 12	5,914,000.00	200,000.0 0	14	3.50	8,049.61	- -
中 信 证 券	2020111700006 119	晶 盛 机 电	2020-11- 17	1,174,906.00	43,100.00	14	3.50	1,599.18	- -
中 信 证 券	2020111700006 121	扬 杰 科 技	2020-11- 17	1,793,600.00	40,000.00	14	3.50	2,441.29	- -
中 信 证 券	2020111700006 123	鼎 龙 股 份	2020-11- 17	188,400.00	12,000.00	14	3.50	256.43	- -
中 信 证 券	2020111900000 425	景 嘉 微	2020-11- 19	605,900.00	10,000.00	14	3.50	824.70	- -
中 信 证 券	2020111900004 412	晶 盛 机 电	2020-11- 19	875,440.00	31,000.00	28	3.40	2,315.05	- -
中 信 证 券	2020112000021 449	卓 胜 微	2020-11- 20	5,502,800.00	10,000.00	14	3.50	7,489.92	- -
中 信 证 券	2020112000021 457	飞 凯 材 料	2020-11- 20	271,271.00	14,300.00	14	3.50	369.23	- -
中 信 证 券	2020112000021 461	扬 杰 科 技	2020-11- 20	2,246,000.00	50,000.00	14	3.50	3,057.06	- -
中 信 证 券	2020112000021 463	扬 杰 科 技	2020-11- 20	4,173,068.00	92,900.00	14	3.50	5,680.01	- -
中 信 证 券	2020112000021 465	扬 杰 科	2020-11- 20	1,963,004.00	43,700.00	14	3.50	2,671.87	- -

券		技							
中 信 证 券	2020112000021 467	晶 盛 机 电	2020-11- 20	1,160,000.00	40,000.00	14	3.50	1,578.89	-
中 信 证 券	2020112000021 469	晶 盛 机 电	2020-11- 20	4,060,000.00	140,000.0 0	14	3.50	5,526.11	-
中 信 证 券	2020112000021 477	上 海 新 阳	2020-11- 20	543,000.00	10,000.00	14	3.10	654.62	-
中 信 证 券	2020112000021 481	鼎 龙 股 份	2020-11- 20	1,362,760.00	86,800.00	14	3.50	1,854.87	-
中 信 证 券	2020112400000 490	晶 盛 机 电	2020-11- 24	444,904.00	15,200.00	14	3.50	605.56	-
中 信 证 券	2020112400007 616	卓 胜 微	2020-11- 24	9,180,000.00	17,000.00	14	3.50	12,495.00	-
中 信 证 券	2020112400007 618	扬 杰 科 技	2020-11- 24	946,000.00	20,000.00	14	3.60	1,324.40	-
中 信 证 券	2020112400007 620	晶 盛 机 电	2020-11- 24	1,756,200.00	60,000.00	14	3.60	2,458.68	-
中 信 证 券	2020112400008 616	晶 盛 机 电	2020-11- 24	1,756,200.00	60,000.00	14	3.60	2,458.68	-
中 信 证 券	2020112400008 618	景 嘉 微	2020-11- 24	606,100.00	10,000.00	14	3.50	824.97	-
中 信 证 券	2020112400008 620	扬 杰 科	2020-11- 24	2,838,000.00	60,000.00	14	3.60	3,973.20	-

券		技							
中 信 证 券	2020112600000 453	卓 胜 微	2020-11- 26	5,480,000.00	10,000.00	28	3.40	14,491.56	- -
中 信 证 券	2020112600000 461	全 志 科 技	2020-11- 26	567,600.00	15,000.00	14	3.70	816.71	- -
中 信 证 券	2020112600002 652	全 志 科 技	2020-11- 26	378,400.00	10,000.00	14	3.50	515.04	- -
中 信 证 券	2020112600002 654	晶 盛 机 电	2020-11- 26	5,766,000.0 0	200,000.0 0	14	3.60	8,072.40	- -
中 信 证 券	2020120100002 803	晶 盛 机 电	2020-12- 01	1,249,900.00	43,100.00	14	3.50	1,701.25	- -
中 信 证 券	2020120100002 805	扬 杰 科 技	2020-12- 01	1,782,000.00	40,000.00	14	3.60	2,494.80	- -
中 信 证 券	2020120100002 807	鼎 龙 股 份	2020-12- 01	200,160.00	12,000.00	14	3.50	272.44	- -
中 信 证 券	2020120300003 582	景 嘉 微	2020-12- 03	614,900.00	10,000.00	14	3.50	836.95	- -
中 信 证 券	2020120400004 984	晶 盛 机 电	2020-12- 04	4,177,600.00	140,000.0 0	14	3.50	5,686.18	- -
中 信 证 券	2020120400004 986	全 志 科 技	2020-12- 04	1,112,091.00	30,900.00	28	3.60	2,812.51	- 2,81 2.51
中 信 证 券	2020120400004 988	卓 胜 微	2020-12- 04	5,119,300.00	10,000.00	14	3.50	6,967.94	- -

券									
中 信 证 券	2020120400005 274	景 嘉 微	2020-12- 04	2,132,100.00	34,500.00	28	3.40	5,092.59	- 5,09 2.59
中 信 证 券	2020120400005 276	鼎 龙 股 份	2020-12- 04	1,449,560.00	86,800.00	14	3.50	1,973.01	- -
中 信 证 券	2020120400005 284	扬 杰 科 技	2020-12- 04	2,049,530.00	43,700.00	14	3.60	2,869.34	- -
中 信 证 券	2020120400005 286	上 海 新 阳	2020-12- 04	538,600.00	10,000.00	14	3.20	670.26	- -
中 信 证 券	2020120400005 288	飞 凯 材 料	2020-12- 04	271,414.00	14,300.00	14	3.70	390.53	- -
中 信 证 券	2020120400005 290	扬 杰 科 技	2020-12- 04	4,357,010.00	92,900.00	14	3.60	6,099.81	- -
中 信 证 券	2020120400005 292	晶 盛 机 电	2020-12- 04	1,193,600.00	40,000.00	14	3.50	1,624.62	- -
中 信 证 券	2020120400005 294	扬 杰 科 技	2020-12- 04	2,345,000.00	50,000.00	14	3.60	3,283.00	- -
中 信 证 券	2020120800000 406	圣 邦 股 份	2020-12- 08	2,918,100.00	10,000.00	14	3.50	3,971.86	- -
中 信 证 券	2020120800004 898	晶 盛 机 电	2020-12- 08	442,320.00	15,200.00	14	3.50	602.05	- -
中 信 证 券	2020120800004 902	卓 胜 微	2020-12- 08	9,261,940.00	17,000.00	14	3.90	14,047.28	- -

券									
中 信 证 券	2020120800004 904	晶 盛 机 电	2020-12- 08	1,746,000.00	60,000.00	14	3.50	2,376.50	- -
中 信 证 券	2020120800004 906	晶 盛 机 电	2020-12- 08	1,746,000.00	60,000.00	14	3.50	2,376.50	- -
中 信 证 券	2020120800004 908	扬 杰 科 技	2020-12- 08	2,832,600.00	60,000.00	14	3.60	3,965.64	- -
中 信 证 券	2020120800004 912	扬 杰 科 技	2020-12- 08	944,200.00	20,000.00	14	3.60	1,321.88	- -
中 信 证 券	2020120800004 914	景 嘉 微	2020-12- 08	627,800.00	10,000.00	14	3.50	854.51	- -
中 信 证 券	2020120800004 918	景 嘉 微	2020-12- 08	1,883,400.00	30,000.00	28	3.40	4,091.17	2,0 97, 300 .00
中 信 证 券	2020121000000 291	全 志 科 技	2020-12- 10	420,336.00	10,800.00	28	3.60	882.71	348 ,30 0.0 0
中 信 证 券	2020121000003 506	全 志 科 技	2020-12- 10	389,200.00	10,000.00	14	3.70	560.02	- -
中 信 证 券	2020121000003 512	晶 盛 机 电	2020-12- 10	5,930,000.00	200,000.0 0	14	3.50	8,071.39	- -
中 信 证 券	2020121000003 514	全 志 科 技	2020-12- 10	583,800.00	15,000.00	14	3.70	840.02	- -
中 信 证 券	2020121500000 595	全 志 科	2020-12- 15	389,600.00	10,000.00	14	3.70	560.59	- -

券		技							
中 信 证 券	2020121500000 599	扬 杰 科 技	2020-12- 15	819,000.00	20,000.00	14	3.60	1,146.60	- -
中 信 证 券	2020121500000 615	景 嘉 微	2020-12- 15	1,611,000.00	25,000.00	28	3.40	2,434.40	1,7 47, 750 .00 2,43 4.40
中 信 证 券	2020121500006 169	鼎 龙 股 份	2020-12- 15	203,280.00	12,000.00	14	3.60	284.59	- -
中 信 证 券	2020121500006 171	扬 杰 科 技	2020-12- 15	1,638,000.00	40,000.00	14	3.70	2,356.90	- -
中 信 证 券	2020121500006 507	晶 盛 机 电	2020-12- 15	1,363,253.00	43,100.00	14	3.50	1,855.54	- -
中 信 证 券	2020121700010 827	晶 盛 机 电	2020-12- 17	985,180.00	31,000.00	28	3.40	1,302.63	932 ,48 0.0 0 1,30 2.63
中 信 证 券	2020121800008 647	晶 盛 机 电	2020-12- 18	4,501,000.00	140,000.0 0	14	3.50	5,045.24	- 5,04 5.24
中 信 证 券	2020121800008 649	卓 胜 微	2020-12- 18	5,760,000.00	10,000.00	14	4.50	8,301.18	- 8,30 1.18
中 信 证 券	2020121800008 651	上 海 新 阳	2020-12- 18	499,400.00	10,000.00	14	3.10	495.81	- 495. 81
中 信 证 券	2020121800008 653	飞 凯 材 料	2020-12- 18	256,542.00	14,300.00	14	3.90	320.43	- 320. 43
中 信 证 券	2020121800008 655	鼎 龙 股	2020-12- 18	1,505,112.00	86,800.00	14	3.60	1,735.31	- 1,73 5.31

券		份							
中 信 证 券	2020121800008 657	扬 杰 科 技	2020-12- 18	1,781,649.00	43,700.00	14	3.70	2,111.19	- 2,11 1.19
中 信 证 券	2020121800008 659	扬 杰 科 技	2020-12- 18	3,787,533.00	92,900.00	14	3.70	4,488.10	- 4,48 8.10
中 信 证 券	2020121800008 661	扬 杰 科 技	2020-12- 18	2,038,500.00	50,000.00	14	3.70	2,415.56	- 2,41 5.56
中 信 证 券	2020122200001 064	全 志 科 技	2020-12- 22	1,401,560.00	37,000.00	28	3.50	1,226.37	1,1 93, 250 .00 1,22 6.37
中 信 证 券	2020122200001 079	北 京 君 正	2020-12- 22	288,300.00	3,000.00	28	3.00	216.23	274 ,47 0.0 0 216. 23
中 信 证 券	2020122200010 277	扬 杰 科 技	2020-12- 22	820,600.00	20,000.00	14	3.60	738.54	888 ,40 0.0 0 738. 54
中 信 证 券	2020122200010 377	卓 胜 微	2020-12- 22	9,656,000.00	17,000.00	14	4.40	10,621.60	9,6 99, 180 .00 10,6 21.6 0
中 信 证 券	2020122200010 383	景 嘉 微	2020-12- 22	630,000.00	10,000.00	14	3.50	551.25	699 ,10 0.0 0 551. 25
中 信 证 券	2020122200010 385	晶 盛 机 电	2020-12- 22	485,336.00	15,200.00	14	3.50	424.67	457 ,21 6.0 0 424. 67
中 信 证 券	2020122200010 387	晶 盛 机 电	2020-12- 22	1,915,800.00	60,000.00	14	3.50	1,676.33	1,8 04, 800 .00 1,67 6.33
中 信 证 券	2020122200010 389	晶 盛 机	2020-12- 22	1,915,800.00	60,000.00	14	3.50	1,676.33	1,8 04, 800 1,67 6.33

券		电						.00	
中 信 证 券	2020122200010 391	圣 邦 股 份	2020-12- 22	2,717,400.00	10,000.00	14	3.70	2,513.60	2,6 38, 000 .00
中 信 证 券	2020122200010 393	扬 杰 科 技	2020-12- 22	2,461,800.00	60,000.00	14	3.60	2,215.62	2,6 65, 200 .00
中 信 证 券	2020122400001 342	晶 盛 机 电	2020-12- 24	328,500.00	10,000.00	14	3.50	223.57	300 ,80 0.0 0
中 信 证 券	2020122400013 411	全 志 科 技	2020-12- 24	366,100.00	10,000.00	14	3.70	263.39	322 ,50 0.0 0
中 信 证 券	2020122400013 413	全 志 科 技	2020-12- 24	549,150.00	15,000.00	14	3.70	395.09	483 ,75 0.0 0
中 信 证 券	2020122400013 417	晶 盛 机 电	2020-12- 24	6,570,000.00	200,000.0 0	14	3.50	4,471.25	6,0 16, 000 .00
中 信 证 券	2020122900000 522	上 海 新 阳	2020-12- 29	485,800.00	10,000.00	14	3.50	94.46	492 ,90 0.0 0
中 信 证 券	2020122900000 524	北 京 君 正	2020-12- 29	908,900.00	10,000.00	14	3.40	171.68	914 ,90 0.0 0
中 信 证 券	2020122900000 528	南 大 光 电	2020-12- 29	1,997,500.00	50,000.00	14	4.30	477.18	2,0 15, 500 .00
中 信 证 券	2020122900000 558	景 嘉 微	2020-12- 29	681,400.00	10,000.00	28	3.30	124.92	699 ,10 0.0 0
中 信 证 券	2020122900007 123	扬 杰 科	2020-12- 29	845,000.00	20,000.00	14	3.50	164.31	888 ,40 0.0

券		技						0	
中 信 证 券	2020122900007 125	全 志 科 技	2020-12- 29	322,100.00	10,000.00	14	3.60	64.42	322 ,50 0.0 0
中 信 证 券	2020123100000 271	景 嘉 微	2020-12- 31	699,100.00	10,000.00	14	3.40	-	699 ,10 0.0 0
中 信 证 券	2020123100000 277	扬 杰 科 技	2020-12- 31	710,720.00	16,000.00	14	3.50	-	710 ,72 0.0 0

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券	24,183,673.00	0.12%
华夏国证半导体 芯片 ETF 联接	2,916,189,182.00	14.90%

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

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存 款	97,894,089.73	2,402,460.10

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

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入
				本期 2020年1月20日（基金合同生效日）至2020年12月31日

				数量(单位: 股/张)	总金额
中信证券	688057	金达莱	新股发行	21,850	564,604.00
中信证券	300896	爱美客	新股发行	4,730	559,417.10
中信证券	688289	圣湘生物	新股发行	6,806	343,566.88
中信证券	688221	前沿生物	新股发行	16,148	331,034.00
中信证券	688578	艾力斯	新股发行	10,734	243,983.82
中信证券	688617	惠泰医疗	新股发行	1,673	124,571.58
中信证券	688559	海目星	新股发行	5,924	86,253.44
中信证券	300898	熊猫乳品	新股发行	4,953	53,393.34
中信证券	605136	丽人丽妆	新股发行	867	10,603.41
中信证券	003013	地铁设计	新股发行	724	9,723.32
中信证券	605099	共创草坪	新股发行	624	9,634.56
中信证券	003018	金富科技	新股发行	1,027	9,171.11
中信证券	605179	一鸣食品	新股发行	939	8,648.19
中信证券	003015	日久光电	新股发行	1,128	7,410.96
中信证券	605299	舒华体育	新股发行	738	5,365.26
中信证券	003006	百亚股份	新股发行	804	5,314.44

#### 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

本基金本报告期无利润分配事项。

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

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603501	韦尔股份	2020-12-11	2021-06-11	非公开发行流通	215.90	213.18	400,000	86,360,000.00	85,272,000.00	-

				受限						
603501	韦尔股份	2020-11-09	2021-05-10	非公开发行流通受限	208.34	214.38	300,000	62,502,000.00	64,314,000.00	-
300782	卓胜微	2020-10-30	2021-04-30	非公开发行流通受限	385.02	527.20	100,000	38,502,000.00	52,720,000.00	-
600745	闻泰科技	2020-07-31	2021-02-01	非公开发行流通受限	135.16	96.82	510,000	68,931,600.00	49,378,200.00	-
300456	赛微电子	2020-11-19	2021-05-19	非公开发行流通受限	25.00	22.14	1,500,000	37,500,000.00	33,210,000.00	-
688561	奇安信	2020-07-16	2021-01-22	新发流通受限	56.10	122.83	23,563	1,321,884.30	2,894,243.29	-

601995	中金公司	2020-10-22	2021-05-06	新发流通受限	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
300888	稳健医疗	2020-09-09	2021-03-17	新发流通受限	74.30	156.39	10,265	762,689.50	1,605,343.35	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新发流通受限	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
688289	圣湘生物	2020-08-20	2021-03-01	新发流通受限	50.48	109.84	6,806	343,566.88	747,571.04	-
688788	科思科技	2020-10-13	2021-04-22	新发流通受限	106.04	109.59	3,629	384,819.16	397,702.11	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新发流通受限	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新发流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
300869	康泰	2020-08-12	2021-02-24	新发	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-

	医学			流通受限						
688551	科威尔	2020-09-01	2021-03-10	新发流通受限	37.94	33.34	2,211	83,885.34	73,714.74	-
688577	浙海德曼	2020-09-08	2021-03-16	新发流通受限	33.13	42.01	1,503	49,794.39	63,141.03	-
688557	兰剑智能	2020-11-25	2021-06-02	新发流通受限	27.70	32.75	1,812	50,192.40	59,343.00	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新发流通受限	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	新发流通受限	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新发流通受限	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新发流通	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-

				受限						
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新发流通受限	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300870	欧陆通	2020-08-13	2021-02-24	新发流通受限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新发流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	新发流通受限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新发流通受限	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新发流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-24	新发流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-

300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新发流通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新发流通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新发流通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300902	国安达	2020-10-22	2021-04-29	新发流通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300925	法本信息	2020-12-21	2021-06-30	新发流通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新发流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	新发流通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300907	康平	2020-11-11	2021-05-18	新发	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	-

	科 技			流 通 受 限						
300879	大 叶 股 份	2020-08-25	2021-03-01	新 发 流 通 受 限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万 胜 智 能	2020-08-27	2021-03-10	新 发 流 通 受 限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿 田 智 能	2020-11-24	2021-06-03	新 发 流 通 受 限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300893	松 原 股 份	2020-09-17	2021-03-24	新 发 流 通 受 限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300918	南 山 智 尚	2020-12-15	2021-06-22	新 发 流 通 受 限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300881	盛 德 鑫 泰	2020-08-25	2021-03-05	新 发 流 通 受 限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300922	天 秦 装 备	2020-12-18	2021-06-25	新 发 流 通	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-

				受限						
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	新发流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新发流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新发流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	新发流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新发流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新发流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新发流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-

**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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113616	韦尔转债	2020-12-28	2021-01-22	新发流通受限	100.00	100.00	152,930	15,293,000.00	15,293,000.00	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

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

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式

减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

⑥以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
2020120400001450	002185	华天科技	2020-12-04	2020-12-31	13.62	200,000.00	2,724,000.00
2020120400001452	002156	通富微电	2020-12-04	2020-12-31	25.24	50,000.00	1,262,000.00
2020120400002214	603501	韦尔股份	2020-12-04	2020-12-31	231.10	16,000.00	3,697,600.00
2020120400002220	603501	韦尔股份	2020-12-04	2020-12-31	231.10	16,000.00	3,697,600.00

2020120400002904	002049	紫光国微	2020-12-04	2020-12-31	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020120400002920	002156	通富微电	2020-12-04	2020-12-31	25.24	28,000.00	706,720.00
2020120400002924	600667	太极实业	2020-12-04	2020-12-31	9.45	14,700.00	138,915.00
2020120400003056	002185	华天科技	2020-12-04	2020-12-31	13.62	70,000.00	953,400.00
2020120400003064	002049	紫光国微	2020-12-04	2020-12-31	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020120400003070	002049	紫光国微	2020-12-04	2020-12-31	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020120400003072	002156	通富微电	2020-12-04	2020-12-31	25.24	21,000.00	530,040.00
2020120400003074	002371	北方华创	2020-12-04	2020-12-31	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020120400003076	600584	长电科技	2020-12-04	2020-12-31	42.57	12,000.00	510,840.00
2020120400003078	600584	长电科技	2020-12-04	2020-12-31	42.57	13,000.00	553,410.00
2020120400003080	600460	士兰微	2020-12-04	2020-12-31	25.00	32,000.00	800,000.00
2020120400003316	600584	长	2020-12-04	2020-12-31	42.57	90,000.00	3,831,300.00

		电 科 技					
2020120400004736	300474	景 嘉 微	2020-12-04	2020-12-31	69.91	10,000.00	699,100.00
2020120400004738	300316	晶 盛 机 电	2020-12-04	2020-12-31	30.08	100,000.00	3,008,000.00
2020120400004968	300316	晶 盛 机 电	2020-12-04	2020-12-31	30.08	10,000.00	300,800.00
2020120400004986	300458	全 志 科 技	2020-12-04	2020-12-31	32.25	30,900.00	996,525.00
2020120400005274	300474	景 嘉 微	2020-12-04	2020-12-31	69.91	34,500.00	2,411,895.00
2020120400005388	300373	扬 杰 科 技	2020-12-04	2020-12-31	44.42	60,000.00	2,665,200.00
2020120400005592	300458	全 志 科 技	2020-12-04	2020-12-31	32.25	15,000.00	483,750.00
2020120400005594	300458	全 志 科 技	2020-12-04	2020-12-31	32.25	16,000.00	516,000.00
2020120400005596	300236	上 海 新 阳	2020-12-04	2020-12-31	49.29	10,000.00	492,900.00
2020120400005598	300316	晶 盛 机 电	2020-12-04	2020-12-31	30.08	12,000.00	360,960.00
2020120800000392	300054	鼎 龙 股	2020-12-08	2021-01-04	18.91	121,000.00	2,288,110.00

		份					
2020120800000404	300782	卓胜微	2020-12-08	2021-01-04	570.54	7,000.00	3,993,780.00
2020120800000408	300346	南大光电	2020-12-08	2021-01-04	40.31	20,000.00	806,200.00
2020120800000409	300346	南大光电	2020-12-08	2021-01-04	40.31	20,000.00	806,200.00
2020120800000414	300346	南大光电	2020-12-08	2021-01-04	40.31	30,000.00	1,209,300.00
2020120800000416	300316	晶盛机电	2020-12-08	2021-01-04	30.08	40,000.00	1,203,200.00
2020120800000420	300223	北京君正	2020-12-08	2021-01-04	91.49	20,000.00	1,829,800.00
2020120800000594	002049	紫光国微	2020-12-08	2021-01-04	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020120800000615	002129	中环股份	2020-12-08	2021-01-04	25.50	30,000.00	765,000.00
2020120800000616	002129	中环股份	2020-12-08	2021-01-04	25.50	1,000,000.00	25,500,000.00
2020120800000619	002129	中环股份	2020-12-08	2021-01-04	25.50	240,000.00	6,120,000.00
2020120800000628	002156	通富微电	2020-12-08	2021-01-04	25.24	20,000.00	504,800.00

2020120800000633	002185	华天科技	2020-12-08	2021-01-04	13.62	51,000.00	694,620.00
2020120800000635	002185	华天科技	2020-12-08	2021-01-04	13.62	92,000.00	1,253,040.00
2020120800000637	002185	华天科技	2020-12-08	2021-01-04	13.62	50,000.00	681,000.00
2020120800000674	002371	北方华创	2020-12-08	2021-01-04	180.74	200,000.00	36,148,000.00
2020120800000678	002371	北方华创	2020-12-08	2021-01-04	180.74	20,000.00	3,614,800.00
2020120800000767	600584	长电科技	2020-12-08	2021-01-04	42.57	10,000.00	425,700.00
2020120800000793	600584	长电科技	2020-12-08	2021-01-04	42.57	19,000.00	808,830.00
2020120800000815	600745	闻泰科技	2020-12-08	2021-01-04	99.00	910,000.00	90,090,000.00
2020120800000980	603005	晶方科技	2020-12-08	2021-01-04	64.36	20,000.00	1,287,200.00
2020120800000988	603005	晶方科技	2020-12-08	2021-01-04	64.36	14,000.00	901,040.00
2020120800000992	603005	晶方科技	2020-12-08	2021-01-04	64.36	10,000.00	643,600.00

2020120800001004	600667	太极实业	2020-12-08	2021-01-04	9.45	205,900.00	1,945,755.00
2020120800002156	002185	华天科技	2020-12-08	2021-01-04	13.62	35,000.00	476,700.00
2020120800002158	002156	通富微电	2020-12-08	2021-01-04	25.24	23,000.00	580,520.00
2020120800002170	600460	士兰微	2020-12-08	2021-01-04	25.00	40,000.00	1,000,000.00
2020120800002174	600584	长电科技	2020-12-08	2021-01-04	42.57	100,000.00	4,257,000.00
2020120800002206	603501	韦尔股份	2020-12-08	2021-01-04	231.10	14,000.00	3,235,400.00
2020120800002356	002049	紫光国微	2020-12-08	2021-01-04	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020120800002358	002129	中环股份	2020-12-08	2021-01-04	25.50	10,000.00	255,000.00
2020120800003250	002129	中环股份	2020-12-08	2021-01-04	25.50	63,000.00	1,606,500.00
2020120800003256	002185	华天科技	2020-12-08	2021-01-04	13.62	488,400.00	6,652,008.00
2020120800003258	002049	紫光国微	2020-12-08	2021-01-04	133.81	76,000.00	10,169,560.00
2020120800003264	600584	长	2020-12-08	2021-01-04	42.57	50,000.00	2,128,500.00

		电 科 技					
2020120800003270	600584	长 电 科 技	2020-12-08	2021-01-04	42.57	30,000.00	1,277,100.00
2020120800003306	603986	兆 易 创 新	2020-12-08	2021-01-04	197.50	27,000.00	5,332,500.00
2020120800003530	002371	北 方 华 创	2020-12-08	2021-01-04	180.74	24,500.00	4,428,130.00
2020120800003628	600703	三 安 光 电	2020-12-08	2021-01-04	27.01	65,000.00	1,755,650.00
2020120800003630	002371	北 方 华 创	2020-12-08	2021-01-04	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020120800003656	600584	长 电 科 技	2020-12-08	2021-01-04	42.57	50,000.00	2,128,500.00
2020120800003662	600584	长 电 科 技	2020-12-08	2021-01-04	42.57	60,000.00	2,554,200.00
2020120800003828	002156	通 富 微 电	2020-12-08	2021-01-04	25.24	15,200.00	383,648.00
2020120800003910	600745	闻 泰 科 技	2020-12-08	2021-01-04	99.00	10,000.00	990,000.00
2020120800004316	600584	长 电 科 技	2020-12-08	2021-01-04	42.57	250,000.00	10,642,500.00
2020120800004482	300236	上	2020-12-08	2021-01-04	49.29	30,000.00	1,478,700.00

		海新阳					
2020120800004698	300316	晶盛机电	2020-12-08	2021-01-04	30.08	11,000.00	330,880.00
2020120800004722	300666	江丰电子	2020-12-08	2021-01-04	49.51	10,000.00	495,100.00
2020120800004812	300054	鼎龙股份	2020-12-08	2021-01-04	18.91	21,400.00	404,674.00
2020120800004892	300373	扬杰科技	2020-12-08	2021-01-04	44.42	10,000.00	444,200.00
2020120800004910	300373	扬杰科技	2020-12-08	2021-01-04	44.42	30,000.00	1,332,600.00
2020120800004918	300474	景嘉微	2020-12-08	2021-01-04	69.91	30,000.00	2,097,300.00
2020120800004962	300666	江丰电子	2020-12-08	2021-01-04	49.51	17,600.00	871,376.00
2020120900002034	600584	长电科技	2020-12-09	2021-01-05	42.57	100,000.00	4,257,000.00
2020120900003476	300236	上海新阳	2020-12-09	2021-01-05	49.29	40,000.00	1,971,600.00
2020121000000269	300223	北京君正	2020-12-10	2021-01-06	91.49	50,000.00	4,574,500.00
2020121000000289	300458	全志	2020-12-10	2021-01-06	32.25	15,000.00	483,750.00

		科 技					
2020121000000291	300458	全志科 技	2020-12-10	2021-01-06	32.25	10,800.00	348,300.00
2020121000000301	300346	南大光 电	2020-12-10	2021-01-06	40.31	20,000.00	806,200.00
2020121000000576	002156	通富微 电	2020-12-10	2021-01-06	25.24	10,000.00	252,400.00
2020121000000580	002185	华天科 技	2020-12-10	2021-01-06	13.62	30,000.00	408,600.00
2020121000000756	600745	闻泰科 技	2020-12-10	2021-01-06	99.00	10,000.00	990,000.00
2020121000000774	603986	兆易创 新	2020-12-10	2021-01-06	197.50	15,000.00	2,962,500.00
2020121000000910	600460	士兰微	2020-12-10	2021-01-06	25.00	220,000.00	5,500,000.00
2020121000002032	600584	长电科 技	2020-12-10	2021-01-06	42.57	20,000.00	851,400.00
2020121000002082	002185	华天科 技	2020-12-10	2021-01-06	13.62	30,000.00	408,600.00
2020121000002086	600745	闻泰科 技	2020-12-10	2021-01-06	99.00	850,000.00	84,150,000.00
2020121000002088	002156	通富微 电	2020-12-10	2021-01-06	25.24	10,900.00	275,116.00

		电					
2020121000002092	002049	紫光国微	2020-12-10	2021-01-06	133.81	51,300.00	6,864,453.00
2020121000002108	600745	闻泰科技	2020-12-10	2021-01-06	99.00	20,000.00	1,980,000.00
2020121000002172	002185	华天科技	2020-12-10	2021-01-06	13.62	290,000.00	3,949,800.00
2020121000002322	002156	通富微电	2020-12-10	2021-01-06	25.24	100,000.00	2,524,000.00
2020121000002324	002185	华天科技	2020-12-10	2021-01-06	13.62	50,000.00	681,000.00
2020121000002332	600460	士兰微	2020-12-10	2021-01-06	25.00	42,300.00	1,057,500.00
2020121000002420	002156	通富微电	2020-12-10	2021-01-06	25.24	10,000.00	252,400.00
2020121000002424	002185	华天科技	2020-12-10	2021-01-06	13.62	14,200.00	193,404.00
2020121000002468	600460	士兰微	2020-12-10	2021-01-06	25.00	11,900.00	297,500.00
2020121000002478	600667	太极实业	2020-12-10	2021-01-06	9.45	19,000.00	179,550.00
2020121000002666	002049	紫光国微	2020-12-10	2021-01-06	133.81	20,000.00	2,676,200.00
2020121000002752	002129	中	2020-12-10	2021-01-06	25.50	28,000.00	714,000.00

		环股份					
2020121000003380	300782	卓胜微	2020-12-10	2021-01-06	570.54	10,000.00	5,705,400.00
2020121000003382	300236	上海新阳	2020-12-10	2021-01-06	49.29	20,000.00	985,800.00
2020121000003386	300373	扬杰科技	2020-12-10	2021-01-06	44.42	150,000.00	6,663,000.00
2020121000003400	300316	晶盛机电	2020-12-10	2021-01-06	30.08	10,000.00	300,800.00
2020121000003468	300398	飞凯材料	2020-12-10	2021-01-06	17.76	109,000.00	1,935,840.00
2020121000003472	300054	鼎龙股份	2020-12-10	2021-01-06	18.91	70,000.00	1,323,700.00
2020121000003476	300474	景嘉微	2020-12-10	2021-01-06	69.91	12,000.00	838,920.00
2020121000003478	300782	卓胜微	2020-12-10	2021-01-06	570.54	10,000.00	5,705,400.00
2020121000003498	300398	飞凯材料	2020-12-10	2021-01-06	17.76	28,000.00	497,280.00
2020121000003500	300666	江丰电子	2020-12-10	2021-01-06	49.51	11,000.00	544,610.00
2020121000003510	300373	扬杰科技	2020-12-10	2021-01-06	44.42	30,000.00	1,332,600.00

2020121000003972	300316	晶盛机电	2020-12-10	2021-01-06	30.08	10,000.00	300,800.00
2020121500000601	300458	全志科技	2020-12-15	2021-01-11	32.25	20,000.00	645,000.00
2020121500000603	300458	全志科技	2020-12-15	2021-01-11	32.25	12,000.00	387,000.00
2020121500000605	300458	全志科技	2020-12-15	2021-01-11	32.25	20,000.00	645,000.00
2020121500000607	300223	北京君正	2020-12-15	2021-01-11	91.49	7,000.00	640,430.00
2020121500000609	300782	卓胜微	2020-12-15	2021-01-11	570.54	40,000.00	22,821,600.00
2020121500000611	300223	北京君正	2020-12-15	2021-01-11	91.49	29,000.00	2,653,210.00
2020121500000615	300474	景嘉微	2020-12-15	2021-01-11	69.91	25,000.00	1,747,750.00
2020121500000617	300346	南大光电	2020-12-15	2021-01-11	40.31	77,000.00	3,103,870.00
2020121500001301	002049	紫光国微	2020-12-15	2021-01-11	133.81	13,500.00	1,806,435.00
2020121500001346	002129	中环股份	2020-12-15	2021-01-11	25.50	1,000,000.00	25,500,000.00
2020121500001347	002129	中环	2020-12-15	2021-01-11	25.50	150,000.00	3,825,000.00

		股 份					
2020121500001376	002185	华天科技	2020-12-15	2021-01-11	13.62	100,000.00	1,362,000.00
2020121500001461	002371	北方华创	2020-12-15	2021-01-11	180.74	20,000.00	3,614,800.00
2020121500001709	600584	长电科技	2020-12-15	2021-01-11	42.57	30,000.00	1,277,100.00
2020121500002205	600460	士兰微	2020-12-15	2021-01-11	25.00	30,000.00	750,000.00
2020121500002222	600460	士兰微	2020-12-15	2021-01-11	25.00	150,000.00	3,750,000.00
2020121500002241	600460	士兰微	2020-12-15	2021-01-11	25.00	50,000.00	1,250,000.00
2020121500002331	603005	晶方科技	2020-12-15	2021-01-11	64.36	30,000.00	1,930,800.00
2020121500004055	600584	长电科技	2020-12-15	2021-01-11	42.57	40,000.00	1,702,800.00
2020121500004057	600584	长电科技	2020-12-15	2021-01-11	42.57	100,000.00	4,257,000.00
2020121500004099	002049	紫光国微	2020-12-15	2021-01-11	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020121500004287	600584	长电科技	2020-12-15	2021-01-11	42.57	39,000.00	1,660,230.00
2020121500004289	002129	中	2020-12-15	2021-01-11	25.50	43,000.00	1,096,500.00

		环股份					
2020121500004295	603501	韦尔股份	2020-12-15	2021-01-11	231.10	10,000.00	2,311,000.00
2020121500004853	002156	通富微电	2020-12-15	2021-01-11	25.24	25,000.00	631,000.00
2020121500004857	002185	华天科技	2020-12-15	2021-01-11	13.62	52,000.00	708,240.00
2020121500004859	600667	太极实业	2020-12-15	2021-01-11	9.45	52,000.00	491,400.00
2020121500004861	002185	华天科技	2020-12-15	2021-01-11	13.62	37,000.00	503,940.00
2020121500004865	600584	长电科技	2020-12-15	2021-01-11	42.57	19,000.00	808,830.00
2020121500004867	002049	紫光国微	2020-12-15	2021-01-11	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020121500004883	603986	兆易创新	2020-12-15	2021-01-11	197.50	10,000.00	1,975,000.00
2020121500004885	600460	士兰微	2020-12-15	2021-01-11	25.00	39,000.00	975,000.00
2020121500004887	002185	华天科技	2020-12-15	2021-01-11	13.62	39,000.00	531,180.00
2020121500004889	002185	华天	2020-12-15	2021-01-11	13.62	48,000.00	653,760.00

		科 技					
2020121500004891	603501	韦 尔 股 份	2020-12-15	2021-01-11	231.10	10,000.00	2,311,000.00
2020121500004893	603160	汇 顶 科 技	2020-12-15	2021-01-11	155.55	10,000.00	1,555,500.00
2020121500004895	002156	通 富 微 电	2020-12-15	2021-01-11	25.24	200,000.00	5,048,000.00
2020121500005515	603986	兆 易 创 新	2020-12-15	2021-01-11	197.50	10,000.00	1,975,000.00
2020121500005517	600460	士 兰 微	2020-12-15	2021-01-11	25.00	110,000.00	2,750,000.00
2020121500005519	603160	汇 顶 科 技	2020-12-15	2021-01-11	155.55	10,000.00	1,555,500.00
2020121500005521	603501	韦 尔 股 份	2020-12-15	2021-01-11	231.10	10,000.00	2,311,000.00
2020121500005523	600584	长 电 科 技	2020-12-15	2021-01-11	42.57	60,000.00	2,554,200.00
2020121500005527	002156	通 富 微 电	2020-12-15	2021-01-11	25.24	200,000.00	5,048,000.00
2020121500005529	002156	通 富 微 电	2020-12-15	2021-01-11	25.24	40,000.00	1,009,600.00
2020121500005531	002185	华 天 科	2020-12-15	2021-01-11	13.62	45,600.00	621,072.00

		技					
2020121500005533	600584	长电科技	2020-12-15	2021-01-11	42.57	80,000.00	3,405,600.00
2020121500005583	600584	长电科技	2020-12-15	2021-01-11	42.57	14,000.00	595,980.00
2020121500005585	600584	长电科技	2020-12-15	2021-01-11	42.57	42,000.00	1,787,940.00
2020121500005975	002185	华天科技	2020-12-15	2021-01-11	13.62	126,800.00	1,727,016.00
2020121500005977	002371	北方华创	2020-12-15	2021-01-11	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020121500006017	002156	通富微电	2020-12-15	2021-01-11	25.24	40,000.00	1,009,600.00
2020121500006247	300316	晶盛机电	2020-12-15	2021-01-11	30.08	80,000.00	2,406,400.00
2020121500006473	300398	飞凯材料	2020-12-15	2021-01-11	17.76	26,000.00	461,760.00
2020121500006475	300054	鼎龙股份	2020-12-15	2021-01-11	18.91	33,000.00	624,030.00
2020121500006477	300236	上海新阳	2020-12-15	2021-01-11	49.29	15,000.00	739,350.00
2020121500006479	300666	江丰电	2020-12-15	2021-01-11	49.51	14,000.00	693,140.00

		子 公 司 名 称					
2020121500006481	300398	飞凯材料	2020-12-15	2021-01-11	17.76	33,000.00	586,080.00
2020121500006483	300316	晶盛机电	2020-12-15	2021-01-11	30.08	26,000.00	782,080.00
2020121500006485	300054	鼎龙股份	2020-12-15	2021-01-11	18.91	32,000.00	605,120.00
2020121500006487	300661	圣邦股份	2020-12-15	2021-01-11	263.80	10,000.00	2,638,000.00
2020121500006489	300666	江丰电子	2020-12-15	2021-01-11	49.51	12,000.00	594,120.00
2020121500006491	300666	江丰电子	2020-12-15	2021-01-11	49.51	10,000.00	495,100.00
2020121500006493	300661	圣邦股份	2020-12-15	2021-01-11	263.80	10,000.00	2,638,000.00
2020121500006497	300316	晶盛机电	2020-12-15	2021-01-11	30.08	21,000.00	631,680.00
2020121500006499	300398	飞凯材料	2020-12-15	2021-01-11	17.76	27,000.00	479,520.00
2020121500006501	300458	全志科技	2020-12-15	2021-01-11	32.25	14,000.00	451,500.00
2020121500006503	300236	上海新	2020-12-15	2021-01-11	49.29	13,000.00	640,770.00

		阳					
2020121500006505	300316	晶盛机电	2020-12-15	2021-01-11	30.08	23,000.00	691,840.00
2020121500006623	300373	扬杰科技	2020-12-15	2021-01-11	44.42	20,000.00	888,400.00
2020121500006639	300782	卓胜微	2020-12-15	2021-01-11	570.54	10,000.00	5,705,400.00
2020121500006789	300474	景嘉微	2020-12-15	2021-01-11	69.91	17,000.00	1,188,470.00
2020121500006797	300782	卓胜微	2020-12-15	2021-01-11	570.54	2,000.00	1,141,080.00
2020121700001486	300458	全志科技	2020-12-17	2021-01-13	32.25	26,000.00	838,500.00
2020121700001488	300223	北京君正	2020-12-17	2021-01-13	91.49	10,000.00	914,900.00
2020121700001490	300223	北京君正	2020-12-17	2021-01-13	91.49	7,000.00	640,430.00
2020121700001494	300458	全志科技	2020-12-17	2021-01-13	32.25	30,000.00	967,500.00
2020121700001500	300316	晶盛机电	2020-12-17	2021-01-13	30.08	10,000.00	300,800.00
2020121700001502	300316	晶盛机电	2020-12-17	2021-01-13	30.08	85,500.00	2,571,840.00
2020121700001508	300474	景嘉	2020-12-17	2021-01-13	69.91	10,000.00	699,100.00

		微					
2020121700001510	300054	鼎龙股份	2020-12-17	2021-01-13	18.91	40,000.00	756,400.00
2020121700002462	002129	中环股份	2020-12-17	2021-01-13	25.50	400,000.00	10,200,000.00
2020121700002469	002129	中环股份	2020-12-17	2021-01-13	25.50	1,000,000.00	25,500,000.00
2020121700002498	002156	通富微电	2020-12-17	2021-01-13	25.24	103,500.00	2,612,340.00
2020121700002499	002156	通富微电	2020-12-17	2021-01-13	25.24	90,000.00	2,271,600.00
2020121700002533	002156	通富微电	2020-12-17	2021-01-13	25.24	39,000.00	984,360.00
2020121700002537	002185	华天科技	2020-12-17	2021-01-13	13.62	20,000.00	272,400.00
2020121700003253	600584	长电科技	2020-12-17	2021-01-13	42.57	20,000.00	851,400.00
2020121700003268	600584	长电科技	2020-12-17	2021-01-13	42.57	80,000.00	3,405,600.00
2020121700003277	600584	长电科技	2020-12-17	2021-01-13	42.57	37,000.00	1,575,090.00
2020121700004414	600460	士兰微	2020-12-17	2021-01-13	25.00	100,000.00	2,500,000.00

2020121700004434	600460	士 兰 微	2020-12-17	2021-01-13	25.00	47,000.00	1,175,000.00
2020121700004445	600460	士 兰 微	2020-12-17	2021-01-13	25.00	120,000.00	3,000,000.00
2020121700004700	603005	晶 方 科 技	2020-12-17	2021-01-13	64.36	30,000.00	1,930,800.00
2020121700008819	002185	华 天 科 技	2020-12-17	2021-01-13	13.62	140,000.00	1,906,800.00
2020121700008821	002185	华 天 科 技	2020-12-17	2021-01-13	13.62	160,000.00	2,179,200.00
2020121700008967	002156	通 富 微 电	2020-12-17	2021-01-13	25.24	62,200.00	1,569,928.00
2020121700008977	002185	华 天 科 技	2020-12-17	2021-01-13	13.62	91,300.00	1,243,506.00
2020121700008979	600667	太 极 实 业	2020-12-17	2021-01-13	9.45	52,700.00	498,015.00
2020121700008981	002156	通 富 微 电	2020-12-17	2021-01-13	25.24	28,800.00	726,912.00
2020121700008983	600460	士 兰 微	2020-12-17	2021-01-13	25.00	32,700.00	817,500.00
2020121700008995	002049	紫 光 国 微	2020-12-17	2021-01-13	133.81	11,400.00	1,525,434.00
2020121700008997	600460	士 兰 微	2020-12-17	2021-01-13	25.00	600,000.00	15,000,000.00

2020121700009223	002049	紫光国微	2020-12-17	2021-01-13	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020121700009281	002129	中环股份	2020-12-17	2021-01-13	25.50	25,000.00	637,500.00
2020121700009285	600667	太极实业	2020-12-17	2021-01-13	9.45	52,000.00	491,400.00
2020121700009315	002156	通富微电	2020-12-17	2021-01-13	25.24	23,000.00	580,520.00
2020121700009357	600584	长电科技	2020-12-17	2021-01-13	42.57	21,000.00	893,970.00
2020121700009363	600584	长电科技	2020-12-17	2021-01-13	42.57	35,000.00	1,489,950.00
2020121700009489	002185	华天科技	2020-12-17	2021-01-13	13.62	80,000.00	1,089,600.00
2020121700009591	600460	士兰微	2020-12-17	2021-01-13	25.00	29,200.00	730,000.00
2020121700009595	600584	长电科技	2020-12-17	2021-01-13	42.57	300,000.00	12,771,000.00
2020121700009805	002049	紫光国微	2020-12-17	2021-01-13	133.81	38,200.00	5,111,542.00
2020121700009807	002371	北方华创	2020-12-17	2021-01-13	180.74	10,200.00	1,843,548.00
2020121700010041	600584	长	2020-12-17	2021-01-13	42.57	40,000.00	1,702,800.00

		电 科 技					
2020121700010077	002049	紫光国微	2020-12-17	2021-01-13	133.81	20,000.00	2,676,200.00
2020121700010105	600584	长电科技	2020-12-17	2021-01-13	42.57	40,000.00	1,702,800.00
2020121700010107	600584	长电科技	2020-12-17	2021-01-13	42.57	100,000.00	4,257,000.00
2020121700010113	002185	华天科技	2020-12-17	2021-01-13	13.62	10,000.00	136,200.00
2020121700010115	002185	华天科技	2020-12-17	2021-01-13	13.62	60,000.00	817,200.00
2020121700010321	300316	晶盛机电	2020-12-17	2021-01-13	30.08	19,900.00	598,592.00
2020121700010523	300398	飞凯材料	2020-12-17	2021-01-13	17.76	10,000.00	177,600.00
2020121700010529	300316	晶盛机电	2020-12-17	2021-01-13	30.08	70,000.00	2,105,600.00
2020121700010531	300236	上海新阳	2020-12-17	2021-01-13	49.29	10,000.00	492,900.00
2020121700010559	300474	景嘉微	2020-12-17	2021-01-13	69.91	10,000.00	699,100.00
2020121700010597	300236	上海	2020-12-17	2021-01-13	49.29	14,000.00	690,060.00

		新阳					
2020121700010599	300398	飞凯材料	2020-12-17	2021-01-13	17.76	10,000.00	177,600.00
2020121700010601	300398	飞凯材料	2020-12-17	2021-01-13	17.76	10,000.00	177,600.00
2020121700010715	300236	上海新阳	2020-12-17	2021-01-13	49.29	39,000.00	1,922,310.00
2020121700010737	300661	圣邦股份	2020-12-17	2021-01-13	263.80	10,000.00	2,638,000.00
2020121700010739	300666	江丰电子	2020-12-17	2021-01-13	49.51	16,000.00	792,160.00
2020121700010747	300316	晶盛机电	2020-12-17	2021-01-13	30.08	22,000.00	661,760.00
2020121700010749	300398	飞凯材料	2020-12-17	2021-01-13	17.76	32,000.00	568,320.00
2020121700010751	300316	晶盛机电	2020-12-17	2021-01-13	30.08	24,000.00	721,920.00
2020121700010827	300316	晶盛机电	2020-12-17	2021-01-13	30.08	31,000.00	932,480.00
2020121700010953	300782	卓胜微	2020-12-17	2021-01-13	570.54	6,800.00	3,879,672.00
2020121700010957	300316	晶盛机	2020-12-17	2021-01-13	30.08	4,800.00	144,384.00

		电					
2020121800006189	600584	长 电 科 技	2020-12-18	2020-12-31	42.57	50,000.00	2,128,500.00
2020121800006191	002156	通 富 微 电	2020-12-18	2020-12-31	25.24	50,000.00	1,262,000.00
2020121800006199	002185	华 天 科 技	2020-12-18	2020-12-31	13.62	186,600.00	2,541,492.00
2020121800006201	002156	通 富 微 电	2020-12-18	2020-12-31	25.24	124,900.00	3,152,476.00
2020121800006203	002049	紫 光 国 微	2020-12-18	2020-12-31	133.81	18,000.00	2,408,580.00
2020121800006361	002156	通 富 微 电	2020-12-18	2020-12-31	25.24	25,000.00	631,000.00
2020121800006429	603501	韦 尔 股 份	2020-12-18	2020-12-31	231.10	10,000.00	2,311,000.00
2020121800006459	600584	长 电 科 技	2020-12-18	2020-12-31	42.57	10,000.00	425,700.00
2020121800006461	600584	长 电 科 技	2020-12-18	2020-12-31	42.57	10,000.00	425,700.00
2020121800006465	600584	长 电 科 技	2020-12-18	2020-12-31	42.57	20,000.00	851,400.00
2020121800007251	600584	长 电 科	2020-12-18	2020-12-31	42.57	10,000.00	425,700.00

		技					
2020121800007311	002129	中环股份	2020-12-18	2020-12-31	25.50	10,000.00	255,000.00
2020121800008041	600584	长电科技	2020-12-18	2020-12-31	42.57	100,000.00	4,257,000.00
2020121800008079	300373	扬杰科技	2020-12-18	2020-12-31	44.42	100,000.00	4,442,000.00
2020121800008113	300666	江丰电子	2020-12-18	2020-12-31	49.51	10,000.00	495,100.00
2020121800008219	300458	全志科技	2020-12-18	2020-12-31	32.25	20,000.00	645,000.00
2020121800008269	300373	扬杰科技	2020-12-18	2020-12-31	44.42	10,000.00	444,200.00
2020121800008279	300236	上海新阳	2020-12-18	2020-12-31	49.29	10,000.00	492,900.00
2020121800008281	300398	飞凯材料	2020-12-18	2020-12-31	17.76	10,000.00	177,600.00
2020121800008293	300054	鼎龙股份	2020-12-18	2020-12-31	18.91	10,000.00	189,100.00
2020121800008307	300458	全志科技	2020-12-18	2020-12-31	32.25	10,000.00	322,500.00
2020121800008621	300373	扬杰科	2020-12-18	2020-12-31	44.42	80,000.00	3,553,600.00

		技					
2020121800008623	300398	飞凯材料	2020-12-18	2020-12-31	17.76	49,000.00	870,240.00
2020121800008625	300398	飞凯材料	2020-12-18	2020-12-31	17.76	26,000.00	461,760.00
2020121800008627	300236	上海新阳	2020-12-18	2020-12-31	49.29	20,000.00	985,800.00
2020121800008647	300316	晶盛机电	2020-12-18	2020-12-31	30.08	140,000.00	4,211,200.00
2020121800008649	300782	卓胜微	2020-12-18	2020-12-31	570.54	10,000.00	5,705,400.00
2020121800008651	300236	上海新阳	2020-12-18	2020-12-31	49.29	10,000.00	492,900.00
2020121800008653	300398	飞凯材料	2020-12-18	2020-12-31	17.76	14,300.00	253,968.00
2020121800008655	300054	鼎龙股份	2020-12-18	2020-12-31	18.91	86,800.00	1,641,388.00
2020121800008657	300373	扬杰科技	2020-12-18	2020-12-31	44.42	43,700.00	1,941,154.00
2020121800008659	300373	扬杰科技	2020-12-18	2020-12-31	44.42	92,900.00	4,126,618.00
2020121800008661	300373	扬杰科技	2020-12-18	2020-12-31	44.42	50,000.00	2,221,000.00

2020122200001039	300458	全志科技	2020-12-22	2021-01-18	32.25	21,000.00	677,250.00
2020122200001043	300346	南大光电	2020-12-22	2021-01-04	40.31	200,000.00	8,062,000.00
2020122200001045	300346	南大光电	2020-12-22	2021-01-04	40.31	60,000.00	2,418,600.00
2020122200001047	300223	北京君正	2020-12-22	2021-01-04	91.49	3,500.00	320,215.00
2020122200001049	300316	晶盛机电	2020-12-22	2021-01-18	30.08	25,000.00	752,000.00
2020122200001051	300346	南大光电	2020-12-22	2021-01-04	40.31	40,000.00	1,612,400.00
2020122200001053	300316	晶盛机电	2020-12-22	2021-01-18	30.08	47,000.00	1,413,760.00
2020122200001055	300346	南大光电	2020-12-22	2021-01-04	40.31	80,000.00	3,224,800.00
2020122200001057	300346	南大光电	2020-12-22	2021-01-04	40.31	40,000.00	1,612,400.00
2020122200001059	300223	北京君正	2020-12-22	2021-01-18	91.49	10,000.00	914,900.00
2020122200001061	300223	北京君正	2020-12-22	2021-01-18	91.49	10,000.00	914,900.00

2020122200001063	300346	南大光电	2020-12-22	2021-01-04	40.31	50,000.00	2,015,500.00
2020122200001064	300458	全志科技	2020-12-22	2021-01-18	32.25	37,000.00	1,193,250.00
2020122200001069	300223	北京君正	2020-12-22	2021-01-04	91.49	10,000.00	914,900.00
2020122200001071	300236	上海新阳	2020-12-22	2021-01-18	49.29	10,000.00	492,900.00
2020122200001073	300054	鼎龙股份	2020-12-22	2021-01-04	18.91	150,000.00	2,836,500.00
2020122200001079	300223	北京君正	2020-12-22	2021-01-18	91.49	3,000.00	274,470.00
2020122200001085	300346	南大光电	2020-12-22	2021-01-04	40.31	50,000.00	2,015,500.00
2020122200001873	002049	紫光国微	2020-12-22	2021-01-18	133.81	20,000.00	2,676,200.00
2020122200002020	002156	通富微电	2020-12-22	2021-01-18	25.24	80,000.00	2,019,200.00
2020122200002022	002156	通富微电	2020-12-22	2021-01-18	25.24	32,000.00	807,680.00
2020122200002046	002185	华天科技	2020-12-22	2021-01-18	13.62	10,000.00	136,200.00

2020122200002050	002185	华天科技	2020-12-22	2021-01-18	13.62	20,000.00	272,400.00
2020122200002234	002371	北方华创	2020-12-22	2021-01-04	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020122200002235	002371	北方华创	2020-12-22	2021-01-18	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020122200002660	600584	长电科技	2020-12-22	2021-01-18	42.57	100,000.00	4,257,000.00
2020122200002674	600584	长电科技	2020-12-22	2021-01-18	42.57	50,000.00	2,128,500.00
2020122200002834	600584	长电科技	2020-12-22	2021-01-04	42.57	20,000.00	851,400.00
2020122200002851	600584	长电科技	2020-12-22	2021-01-04	42.57	20,000.00	851,400.00
2020122200003324	600460	士兰微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	300,000.00	7,500,000.00
2020122200003340	600460	士兰微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	60,000.00	1,500,000.00
2020122200003350	600460	士兰微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	20,000.00	500,000.00
2020122200003361	600460	士兰微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	170,000.00	4,250,000.00
2020122200003369	600460	士兰微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	60,000.00	1,500,000.00
2020122200003379	600460	士	2020-12-22	2021-01-04	25.00	200,000.00	5,000,000.00

		兰 微					
2020122200003395	600460	士 兰 微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	130,000.00	3,250,000.00
2020122200003414	600460	士 兰 微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	60,000.00	1,500,000.00
2020122200003748	600460	士 兰 微	2020-12-22	2021-01-18	25.00	100,000.00	2,500,000.00
2020122200003768	600460	士 兰 微	2020-12-22	2021-01-18	25.00	10,000.00	250,000.00
2020122200008121	600745	闻 泰 科 技	2020-12-22	2021-01-18	99.00	10,000.00	990,000.00
2020122200008431	600460	士 兰 微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	200,000.00	5,000,000.00
2020122200008433	600584	长 电 科 技	2020-12-22	2021-01-04	42.57	600,000.00	25,542,000.00
2020122200008445	002409	雅 克 科 技	2020-12-22	2021-01-04	60.09	10,000.00	600,900.00
2020122200008743	600584	长 电 科 技	2020-12-22	2021-01-18	42.57	63,300.00	2,694,681.00
2020122200008767	600584	长 电 科 技	2020-12-22	2021-01-04	42.57	100,000.00	4,257,000.00
2020122200008771	002049	紫 光 国 微	2020-12-22	2021-01-18	133.81	45,000.00	6,021,450.00
2020122200008773	002049	紫 光 国	2020-12-22	2021-01-04	133.81	30,000.00	4,014,300.00

		微					
2020122200008775	002185	华天科技	2020-12-22	2021-01-18	13.62	81,600.00	1,111,392.00
2020122200008777	002185	华天科技	2020-12-22	2021-01-04	13.62	11,100.00	151,182.00
2020122200008779	002185	华天科技	2020-12-22	2021-01-18	13.62	100,000.00	1,362,000.00
2020122200008821	600584	长电科技	2020-12-22	2021-01-04	42.57	50,000.00	2,128,500.00
2020122200008823	002371	北方华创	2020-12-22	2021-01-18	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020122200009021	002156	通富微电	2020-12-22	2021-01-04	25.24	55,900.00	1,410,916.00
2020122200009023	002185	华天科技	2020-12-22	2021-01-04	13.62	105,500.00	1,436,910.00
2020122200009025	600667	太极实业	2020-12-22	2021-01-04	9.45	114,000.00	1,077,300.00
2020122200009031	600460	士兰微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	72,500.00	1,812,500.00
2020122200009067	002049	紫光国微	2020-12-22	2021-01-18	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020122200009075	002049	紫光国微	2020-12-22	2021-01-18	133.81	50,000.00	6,690,500.00

2020122200009079	002049	紫光国微	2020-12-22	2021-01-18	133.81	12,000.00	1,605,720.00
2020122200009087	002049	紫光国微	2020-12-22	2021-01-04	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020122200009095	603005	晶方科技	2020-12-22	2021-01-04	64.36	16,800.00	1,081,248.00
2020122200009099	002185	华天科技	2020-12-22	2021-01-18	13.62	100,000.00	1,362,000.00
2020122200009103	002185	华天科技	2020-12-22	2021-01-04	13.62	862,800.00	11,751,336.00
2020122200009107	002129	中环股份	2020-12-22	2021-01-18	25.50	300,000.00	7,650,000.00
2020122200009125	600460	士兰微	2020-12-22	2021-01-04	25.00	150,000.00	3,750,000.00
2020122200009131	002371	北方华创	2020-12-22	2021-01-18	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020122200009143	002371	北方华创	2020-12-22	2021-01-04	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020122200009147	002156	通富微电	2020-12-22	2021-01-04	25.24	23,000.00	580,520.00
2020122200009417	600584	长电科技	2020-12-22	2021-01-04	42.57	30,000.00	1,277,100.00
2020122200009881	002049	紫	2020-12-22	2021-01-04	133.81	10,000.00	1,338,100.00

		光国微					
2020122200009937	002156	通富微电	2020-12-22	2021-01-04	25.24	29,700.00	749,628.00
2020122200010137	300236	上海新阳	2020-12-22	2021-01-04	49.29	19,000.00	936,510.00
2020122200010139	300373	扬杰科技	2020-12-22	2021-01-04	44.42	22,000.00	977,240.00
2020122200010141	300398	飞凯材料	2020-12-22	2021-01-04	17.76	1,000.00	17,760.00
2020122200010143	300316	晶盛机电	2020-12-22	2021-01-04	30.08	6,600.00	198,528.00
2020122200010145	300054	鼎龙股份	2020-12-22	2021-01-04	18.91	2,800.00	52,948.00
2020122200010163	300054	鼎龙股份	2020-12-22	2021-01-18	18.91	75,000.00	1,418,250.00
2020122200010167	300458	全志科技	2020-12-22	2021-01-18	32.25	37,500.00	1,209,375.00
2020122200010263	300458	全志科技	2020-12-22	2021-01-04	32.25	35,100.00	1,131,975.00
2020122200010265	300474	景嘉微	2020-12-22	2021-01-04	69.91	18,400.00	1,286,344.00
2020122200010267	300666	江丰	2020-12-22	2021-01-04	49.51	5,600.00	277,256.00

		电 子					
2020122200010271	300398	飞 凯 材 料	2020-12-22	2021-01-04	17.76	30,000.00	532,800.00
2020122200010273	300666	江 丰 电 子	2020-12-22	2021-01-04	49.51	11,000.00	544,610.00
2020122200010275	300316	晶 盛 机 电	2020-12-22	2021-01-04	30.08	21,000.00	631,680.00
2020122200010277	300373	扬 杰 科 技	2020-12-22	2021-01-04	44.42	20,000.00	888,400.00
2020122200010279	300373	扬 杰 科 技	2020-12-22	2021-01-04	44.42	100,000.00	4,442,000.00
2020122200010301	300373	扬 杰 科 技	2020-12-22	2021-01-04	44.42	60,000.00	2,665,200.00
2020122200010303	300316	晶 盛 机 电	2020-12-22	2021-01-04	30.08	10,000.00	300,800.00
2020122200010305	300236	上 海 新 阳	2020-12-22	2021-01-04	49.29	18,900.00	931,581.00
2020122200010309	300373	扬 杰 科 技	2020-12-22	2021-01-04	44.42	45,000.00	1,998,900.00
2020122200010311	300782	卓 胜 微	2020-12-22	2021-01-04	570.54	1,400.00	798,756.00
2020122200010323	300373	扬 杰 科	2020-12-22	2021-01-18	44.42	50,000.00	2,221,000.00

		技					
2020122200010375	300223	北京君正	2020-12-22	2021-01-04	91.49	20,000.00	1,829,800.00
2020122200010377	300782	卓胜微	2020-12-22	2021-01-04	570.54	17,000.00	9,699,180.00
2020122200010383	300474	景嘉微	2020-12-22	2021-01-04	69.91	10,000.00	699,100.00
2020122200010385	300316	晶盛机电	2020-12-22	2021-01-04	30.08	15,200.00	457,216.00
2020122200010387	300316	晶盛机电	2020-12-22	2021-01-04	30.08	60,000.00	1,804,800.00
2020122200010389	300316	晶盛机电	2020-12-22	2021-01-04	30.08	60,000.00	1,804,800.00
2020122200010391	300661	圣邦股份	2020-12-22	2021-01-04	263.80	10,000.00	2,638,000.00
2020122200010393	300373	扬杰科技	2020-12-22	2021-01-04	44.42	60,000.00	2,665,200.00
2020122200010395	300236	上海新阳	2020-12-22	2021-01-18	49.29	15,000.00	739,350.00
2020122200010461	300316	晶盛机电	2020-12-22	2021-01-04	30.08	20,000.00	601,600.00
2020122300006690	002049	紫光国微	2020-12-23	2021-01-05	133.81	38,000.00	5,084,780.00
2020122300006692	002185	华	2020-12-23	2021-01-05	13.62	200,000.00	2,724,000.00

		天 科 技					
2020122400001328	300346	南 大 光 电	2020-12-24	2021-01-06	40.31	30,000.00	1,209,300.00
2020122400001330	300346	南 大 光 电	2020-12-24	2021-01-06	40.31	20,000.00	806,200.00
2020122400001332	300458	全 志 科 技	2020-12-24	2021-01-06	32.25	30,000.00	967,500.00
2020122400001334	300346	南 大 光 电	2020-12-24	2021-01-06	40.31	20,000.00	806,200.00
2020122400001336	300346	南 大 光 电	2020-12-24	2021-01-06	40.31	200,000.00	8,062,000.00
2020122400001338	300346	南 大 光 电	2020-12-24	2021-01-06	40.31	20,000.00	806,200.00
2020122400001340	300346	南 大 光 电	2020-12-24	2021-01-06	40.31	30,000.00	1,209,300.00
2020122400001342	300316	晶 盛 机 电	2020-12-24	2021-01-06	30.08	10,000.00	300,800.00
2020122400001344	300223	北 京 君 正	2020-12-24	2021-01-06	91.49	20,000.00	1,829,800.00
2020122400001346	300223	北 京 君 正	2020-12-24	2021-01-06	91.49	10,500.00	960,645.00
2020122400001348	300054	鼎	2020-12-24	2021-01-20	18.91	80,000.00	1,512,800.00

		龙股份					
2020122400001350	300223	北京君正	2020-12-24	2021-01-20	91.49	10,000.00	914,900.00
2020122400002799	002129	中环股份	2020-12-24	2021-01-06	25.50	50,000.00	1,275,000.00
2020122400002802	002129	中环股份	2020-12-24	2021-01-20	25.50	380,000.00	9,690,000.00
2020122400002803	002129	中环股份	2020-12-24	2021-01-06	25.50	10,000.00	255,000.00
2020122400002805	002129	中环股份	2020-12-24	2021-01-06	25.50	29,900.00	762,450.00
2020122400002915	002185	华天科技	2020-12-24	2021-01-06	13.62	37,200.00	506,664.00
2020122400003224	002371	北方华创	2020-12-24	2021-01-06	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020122400003964	600584	长电科技	2020-12-24	2021-01-20	42.57	15,000.00	638,550.00
2020122400003977	600584	长电科技	2020-12-24	2021-01-20	42.57	40,000.00	1,702,800.00
2020122400004160	600584	长电科技	2020-12-24	2021-01-06	42.57	30,000.00	1,277,100.00
2020122400004180	600584	长	2020-12-24	2021-01-06	42.57	24,000.00	1,021,680.00

		电 科 技					
2020122400004192	600584	长 电 科 技	2020-12-24	2021-01-06	42.57	60,000.00	2,554,200.00
2020122400005012	600460	士 兰 微	2020-12-24	2021-01-06	25.00	40,000.00	1,000,000.00
2020122400005024	600460	士 兰 微	2020-12-24	2021-01-06	25.00	40,000.00	1,000,000.00
2020122400005039	600460	士 兰 微	2020-12-24	2021-01-06	25.00	100,000.00	2,500,000.00
2020122400005047	600460	士 兰 微	2020-12-24	2021-01-06	25.00	40,000.00	1,000,000.00
2020122400005270	600745	闻 泰 科 技	2020-12-24	2021-01-06	99.00	10,000.00	990,000.00
2020122400005665	600460	士 兰 微	2020-12-24	2021-01-20	25.00	60,000.00	1,500,000.00
2020122400012235	600584	长 电 科 技	2020-12-24	2021-01-20	42.57	35,000.00	1,489,950.00
2020122400012549	002049	紫 光 国 微	2020-12-24	2021-01-20	133.81	15,000.00	2,007,150.00
2020122400012551	002371	北 方 华 创	2020-12-24	2021-01-06	180.74	10,000.00	1,807,400.00
2020122400012667	002185	华 天 科 技	2020-12-24	2021-01-06	13.62	400,000.00	5,448,000.00
2020122400012669	002156	通 富	2020-12-24	2021-01-06	25.24	81,100.00	2,046,964.00

		微电					
2020122400012671	002185	华天科技	2020-12-24	2021-01-06	13.62	22,000.00	299,640.00
2020122400012673	600584	长电科技	2020-12-24	2021-01-06	42.57	30,000.00	1,277,100.00
2020122400012675	002156	通富微电	2020-12-24	2021-01-06	25.24	200,000.00	5,048,000.00
2020122400012677	002156	通富微电	2020-12-24	2021-01-20	25.24	100,000.00	2,524,000.00
2020122400012681	600584	长电科技	2020-12-24	2021-01-20	42.57	60,000.00	2,554,200.00
2020122400012683	002156	通富微电	2020-12-24	2021-01-06	25.24	40,000.00	1,009,600.00
2020122400012711	002156	通富微电	2020-12-24	2021-01-06	25.24	54,800.00	1,383,152.00
2020122400012717	002156	通富微电	2020-12-24	2021-01-06	25.24	45,200.00	1,140,848.00
2020122400012737	600584	长电科技	2020-12-24	2021-01-06	42.57	100,000.00	4,257,000.00
2020122400012807	600584	长电科技	2020-12-24	2021-01-06	42.57	30,000.00	1,277,100.00
2020122400012809	600584	长电	2020-12-24	2021-01-06	42.57	10,000.00	425,700.00

		科 技					
2020122400012815	002185	华 天 科 技	2020-12-24	2021-01-06	13.62	300,000.00	4,086,000.00
2020122400012819	002185	华 天 科 技	2020-12-24	2021-01-06	13.62	40,000.00	544,800.00
2020122400012821	002156	通 富 微 电	2020-12-24	2021-01-06	25.24	42,800.00	1,080,272.00
2020122400012825	600584	长 电 科 技	2020-12-24	2021-01-20	42.57	20,000.00	851,400.00
2020122400012827	002156	通 富 微 电	2020-12-24	2021-01-06	25.24	80,000.00	2,019,200.00
2020122400012829	002156	通 富 微 电	2020-12-24	2021-01-20	25.24	100,000.00	2,524,000.00
2020122400012831	600584	长 电 科 技	2020-12-24	2021-01-06	42.57	60,000.00	2,554,200.00
2020122400012861	002129	中 环 股 份	2020-12-24	2021-01-20	25.50	300,000.00	7,650,000.00
2020122400013007	600460	士 兰 微	2020-12-24	2021-01-06	25.00	170,000.00	4,250,000.00
2020122400013243	300346	南 大 光 电	2020-12-24	2021-01-06	40.31	20,000.00	806,200.00
2020122400013255	300223	北 京 君	2020-12-24	2021-01-06	91.49	30,000.00	2,744,700.00

		正					
2020122400013303	300458	全志科技	2020-12-24	2021-01-06	32.25	49,000.00	1,580,250.00
2020122400013323	300236	上海新阳	2020-12-24	2021-01-06	49.29	15,000.00	739,350.00
2020122400013325	300458	全志科技	2020-12-24	2021-01-06	32.25	22,000.00	709,500.00
2020122400013327	300458	全志科技	2020-12-24	2021-01-20	32.25	15,000.00	483,750.00
2020122400013331	300398	飞凯材料	2020-12-24	2021-01-06	17.76	31,000.00	550,560.00
2020122400013333	300316	晶盛机电	2020-12-24	2021-01-06	30.08	21,000.00	631,680.00
2020122400013335	300666	江丰电子	2020-12-24	2021-01-06	49.51	13,000.00	643,630.00
2020122400013341	300458	全志科技	2020-12-24	2021-01-06	32.25	40,000.00	1,290,000.00
2020122400013345	300458	全志科技	2020-12-24	2021-01-06	32.25	60,000.00	1,935,000.00
2020122400013365	300346	南大光电	2020-12-24	2021-01-06	40.31	20,000.00	806,200.00
2020122400013411	300458	全志科	2020-12-24	2021-01-06	32.25	10,000.00	322,500.00

		技					
2020122400013413	300458	全志科技	2020-12-24	2021-01-06	32.25	15,000.00	483,750.00
2020122400013417	300316	晶盛机电	2020-12-24	2021-01-06	30.08	200,000.00	6,016,000.00
2020122400013537	300458	全志科技	2020-12-24	2021-01-06	32.25	12,000.00	387,000.00
2020122900000522	300236	上海新阳	2020-12-29	2021-01-11	49.29	10,000.00	492,900.00
2020122900000524	300223	北京君正	2020-12-29	2021-01-11	91.49	10,000.00	914,900.00
2020122900000528	300346	南大光电	2020-12-29	2021-01-11	40.31	50,000.00	2,015,500.00
2020122900000532	300223	北京君正	2020-12-29	2021-01-25	91.49	60,000.00	5,489,400.00
2020122900000534	300346	南大光电	2020-12-29	2021-01-11	40.31	100,000.00	4,031,000.00
2020122900000536	300223	北京君正	2020-12-29	2021-01-25	91.49	21,000.00	1,921,290.00
2020122900000546	300346	南大光电	2020-12-29	2021-01-11	40.31	70,000.00	2,821,700.00
2020122900000548	300346	南大光	2020-12-29	2021-01-11	40.31	110,000.00	4,434,100.00

		电					
2020122900000552	300346	南大光电	2020-12-29	2021-01-11	40.31	20,000.00	806,200.00
2020122900000554	300346	南大光电	2020-12-29	2021-01-11	40.31	40,000.00	1,612,400.00
2020122900000556	300373	扬杰科技	2020-12-29	2021-01-25	44.42	30,000.00	1,332,600.00
2020122900000558	300474	景嘉微	2020-12-29	2021-01-25	69.91	10,000.00	699,100.00
2020122900000958	002049	紫光国微	2020-12-29	2021-01-25	133.81	50,000.00	6,690,500.00
2020122900000997	002185	华天科技	2020-12-29	2021-01-11	13.62	98,200.00	1,337,484.00
2020122900000999	002185	华天科技	2020-12-29	2021-01-11	13.62	10,000.00	136,200.00
2020122900001253	600584	长电科技	2020-12-29	2021-01-25	42.57	48,000.00	2,043,360.00
2020122900001282	600584	长电科技	2020-12-29	2021-01-25	42.57	20,000.00	851,400.00
2020122900001394	600584	长电科技	2020-12-29	2021-01-11	42.57	10,000.00	425,700.00
2020122900001423	600584	长电科技	2020-12-29	2021-01-11	42.57	50,000.00	2,128,500.00

2020122900002019	600460	士 兰 微	2020-12-29	2021-01-11	25.00	80,000.00	2,000,000.00
2020122900002025	600460	士 兰 微	2020-12-29	2021-01-11	25.00	10,000.00	250,000.00
2020122900002029	600460	士 兰 微	2020-12-29	2021-01-11	25.00	100,000.00	2,500,000.00
2020122900002032	600460	士 兰 微	2020-12-29	2021-01-11	25.00	32,500.00	812,500.00
2020122900002352	600460	士 兰 微	2020-12-29	2021-01-25	25.00	10,000.00	250,000.00
2020122900002369	600460	士 兰 微	2020-12-29	2021-01-25	25.00	50,000.00	1,250,000.00
2020122900002669	603005	晶 方 科 技	2020-12-29	2021-01-11	64.36	10,000.00	643,600.00
2020122900002735	603005	晶 方 科 技	2020-12-29	2021-01-25	64.36	31,000.00	1,995,160.00
2020122900005581	002049	紫 光 国 微	2020-12-29	2021-01-11	133.81	20,000.00	2,676,200.00
2020122900005583	002049	紫 光 国 微	2020-12-29	2021-01-11	133.81	20,000.00	2,676,200.00
2020122900005623	600584	长 电 科 技	2020-12-29	2021-01-25	42.57	40,000.00	1,702,800.00
2020122900005787	600584	长 电 科 技	2020-12-29	2021-01-11	42.57	40,000.00	1,702,800.00
2020122900006263	002049	紫 光	2020-12-29	2021-01-11	133.81	10,000.00	1,338,100.00

		国 微					
2020122900006315	002156	通 富 微 电	2020-12-29	2021-01-11	25.24	28,000.00	706,720.00
2020122900006839	600745	闻 泰 科 技	2020-12-29	2021-01-11	99.00	10,500.00	1,039,500.00
2020122900006989	600584	长 电 科 技	2020-12-29	2021-01-25	42.57	30,000.00	1,277,100.00
2020122900006991	002185	华 天 科 技	2020-12-29	2021-01-11	13.62	43,500.00	592,470.00
2020122900006993	600745	闻 泰 科 技	2020-12-29	2021-01-11	99.00	10,000.00	990,000.00
2020122900006995	002129	中 环 股 份	2020-12-29	2021-01-25	25.50	25,500.00	650,250.00
2020122900006997	002185	华 天 科 技	2020-12-29	2021-01-25	13.62	60,000.00	817,200.00
2020122900007025	600584	长 电 科 技	2020-12-29	2021-01-11	42.57	200,000.00	8,514,000.00
2020122900007105	300223	北 京 君 正	2020-12-29	2021-01-11	91.49	21,000.00	1,921,290.00
2020122900007107	300223	北 京 君 正	2020-12-29	2021-01-11	91.49	5,000.00	457,450.00
2020122900007123	300373	扬 杰	2020-12-29	2021-01-11	44.42	20,000.00	888,400.00

		科 技					
2020122900007125	300458	全志科 技	2020-12-29	2021-01-11	32.25	10,000.00	322,500.00
2020122900007263	300236	上海新阳	2020-12-29	2021-01-11	49.29	28,000.00	1,380,120.00
2020122900007265	300373	扬杰科 技	2020-12-29	2021-01-11	44.42	20,000.00	888,400.00
2020122900007305	300346	南大光 电	2020-12-29	2021-01-11	40.31	20,000.00	806,200.00
2020122900007675	300054	鼎龙股 份	2020-12-29	2021-01-11	18.91	14,000.00	264,740.00
2020122900007679	300223	北京君正	2020-12-29	2021-01-11	91.49	4,000.00	365,960.00
2020123100000267	300474	景嘉微	2020-12-31	2021-01-13	69.91	17,900.00	1,251,389.00
2020123100000269	300346	南大光 电	2020-12-31	2021-01-13	40.31	10,000.00	403,100.00
2020123100000271	300474	景嘉微	2020-12-31	2021-01-13	69.91	10,000.00	699,100.00
2020123100000273	300346	南大光 电	2020-12-31	2021-01-13	40.31	50,000.00	2,015,500.00
2020123100000275	300346	南大光 电	2020-12-31	2021-01-13	40.31	30,000.00	1,209,300.00

2020123100000277	300373	扬杰科技	2020-12-31	2021-01-13	44.42	16,000.00	710,720.00
2020123100000279	300223	北京君正	2020-12-31	2021-01-27	91.49	20,000.00	1,829,800.00
2020123100000624	603501	韦尔股份	2020-12-31	2021-01-27	231.10	30,000.00	6,933,000.00
2020123100000667	600460	士兰微	2020-12-31	2021-01-13	25.00	160,000.00	4,000,000.00
2020123100000703	600460	士兰微	2020-12-31	2021-01-13	25.00	40,000.00	1,000,000.00
2020123100000708	600460	士兰微	2020-12-31	2021-01-27	25.00	100,000.00	2,500,000.00
2020123100000722	600460	士兰微	2020-12-31	2021-01-13	25.00	50,400.00	1,260,000.00
2020123100000727	600460	士兰微	2020-12-31	2021-01-27	25.00	32,000.00	800,000.00
2020123100001644	002049	紫光国微	2020-12-31	2021-01-13	133.81	10,000.00	1,338,100.00
2020123100001680	002129	中环股份	2020-12-31	2021-01-13	25.50	62,200.00	1,586,100.00
2020123100001688	002371	北方华创	2020-12-31	2021-01-13	180.74	25,300.00	4,572,722.00
2020123100002386	002185	华天科技	2020-12-31	2021-01-27	13.62	50,000.00	681,000.00
2020123100002390	002156	通	2020-12-31	2021-01-27	25.24	20,000.00	504,800.00

		富 微 电					
2020123100002498	603501	韦 尔 股 份	2020-12-31	2021-01-27	231.10	10,000.00	2,311,000.00
2020123100002848	600460	士 兰 微	2020-12-31	2021-01-13	25.00	60,000.00	1,500,000.00
2020123100002854	002049	紫 光 国 微	2020-12-31	2021-01-13	133.81	14,000.00	1,873,340.00
2020123100002884	600460	士 兰 微	2020-12-31	2021-01-13	25.00	50,000.00	1,250,000.00
2020123100002904	002185	华 天 科 技	2020-12-31	2021-01-13	13.62	10,000.00	136,200.00
2020123100004120	002156	通 富 微 电	2020-12-31	2021-01-27	25.24	30,000.00	757,200.00
2020123100004122	600584	长 电 科 技	2020-12-31	2021-01-27	42.57	18,000.00	766,260.00
2020123100009116	600584	长 电 科 技	2020-12-31	2021-01-13	42.57	20,000.00	851,400.00
2020123100009120	002185	华 天 科 技	2020-12-31	2021-01-27	13.62	94,000.00	1,280,280.00
2020123100009134	600584	长 电 科 技	2020-12-31	2021-01-13	42.57	80,000.00	3,405,600.00
2020123100009136	600460	士 兰 微	2020-12-31	2021-01-13	25.00	28,000.00	700,000.00

2020123100009138	600584	长电科技	2020-12-31	2021-01-13	42.57	220,400.00	9,382,428.00
2020123100009140	600584	长电科技	2020-12-31	2021-01-27	42.57	50,000.00	2,128,500.00
2020123100010068	300316	晶盛机电	2020-12-31	2021-01-13	30.08	24,000.00	721,920.00
2020123100010070	300458	全志科技	2020-12-31	2021-01-27	32.25	22,000.00	709,500.00
2020123100010208	300458	全志科技	2020-12-31	2021-01-13	32.25	13,000.00	419,250.00
2020123100010214	300316	晶盛机电	2020-12-31	2021-01-27	30.08	43,000.00	1,293,440.00
2020123100010512	300223	北京君正	2020-12-31	2021-01-13	91.49	7,000.00	640,430.00
2020123100010526	300346	南大光电	2020-12-31	2021-01-13	40.31	100,000.00	4,031,000.00
2020123100010602	300236	上海新阳	2020-12-31	2021-01-13	49.29	38,500.00	1,897,665.00
合计						32,806,400.00	1,325,450,961.00

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

#### 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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理

架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回

申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	23,825,437,771.20	99.80
交易性金融资产—债券投资	15,293,000.00	0.06
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
合计	23,840,730,771.20	99.87

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除国证半导体芯片指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末

		2020 年 12 月 31 日
-5%		-1,119,804,270.92
+5%		1,119,804,270.92

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

##### (2) 各层次金融工具公允价值

截至 2020 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 23,546,340,074.87 元，第二层次的余额为 294,390,696.33 元，第三层次的余额为 0 元。

##### (3) 公允价值所属层次间重大变动

对于特殊事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)的股票，本基金将相关股票公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于股票复牌能体现公允价值并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

##### (4) 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
----	----	----	--------------

1	权益投资	23,825,437,771.20	99.24
	其中：股票	23,825,437,771.20	99.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,293,000.00	0.06
	其中：债券	15,293,000.00	0.06
	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	134,143,117.06	0.56
8	其他各项资产	33,339,243.30	0.14
9	合计	24,008,213,131.56	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 1,325,450,961.00 元，占本基金期末资产净值的 5.55%。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,820,587,603.70	99.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,938,956.92	0.01
J	金融业	1,714,383.21	0.01
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	23,825,413,123.20	99.80

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603501	韦尔股份	11,129,977	2,559,953,684.70	10.72
2	603986	兆易创新	10,754,215	2,123,957,462.50	8.90
3	600703	三安光电	70,628,628	1,907,679,242.28	7.99
4	002049	紫光国微	12,826,444	1,716,306,471.64	7.19
5	300782	卓胜微	2,905,160	1,653,175,986.40	6.93
6	600745	闻泰科技	15,063,628	1,490,187,372.00	6.24
7	600584	长电科技	33,148,867	1,411,147,268.19	5.91
8	002129	中环股份	53,312,680	1,359,473,340.00	5.69
9	002371	北方华创	6,599,152	1,192,730,732.48	5.00
10	603160	汇顶科技	6,609,443	1,028,098,858.65	4.31
11	002185	华天科技	64,319,245	876,028,116.90	3.67
12	300661	圣邦股份	2,725,658	719,028,580.40	3.01
13	600460	士兰微	24,450,174	611,254,350.00	2.56
14	300316	晶盛机电	17,820,372	536,036,789.76	2.25
15	002156	通富微电	19,750,846	498,511,353.04	2.09
16	603005	晶方科技	6,129,028	394,464,242.08	1.65
17	600667	太极实业	41,150,400	388,871,280.00	1.63
18	300054	鼎龙股份	19,674,308	372,041,164.28	1.56
19	002409	雅克科技	6,022,760	361,907,648.40	1.52
20	300346	南大光电	8,752,355	352,807,430.05	1.48
21	300223	北京君正	3,573,916	326,977,574.84	1.37
22	603290	斯达半导	1,263,157	304,294,521.30	1.27
23	300373	扬杰科技	6,285,095	279,183,919.90	1.17
24	300236	上海新阳	5,345,908	263,499,805.32	1.10
25	300474	景嘉微	3,582,788	250,472,709.08	1.05
26	300456	赛微电子	9,555,907	225,101,704.74	0.94
27	300458	全志科技	6,095,557	196,581,713.25	0.82
28	300398	飞凯材料	9,214,727	163,653,551.52	0.69
29	300666	江丰电子	3,158,139	156,359,461.89	0.65
30	603893	瑞芯微	1,324,784	95,848,122.40	0.40
31	688561	奇安信	23,563	2,894,243.29	0.01
32	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.01
33	300888	稳健医疗	10,265	1,605,343.35	0.01
34	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.00

35	688289	圣湘生物	6,806	747,571.04	0.00
36	688788	科思科技	3,629	397,702.11	0.00
37	300896	爱美客	473	285,389.28	0.00
38	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
39	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.00
40	688551	科威尔	2,211	73,714.74	0.00
41	688577	浙海德曼	1,503	63,141.03	0.00
42	688557	兰剑智能	1,812	59,343.00	0.00
43	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
44	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
45	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
46	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
47	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
48	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
49	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
50	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
51	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
52	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
53	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
54	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
55	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
56	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
57	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
58	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
59	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
60	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
61	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
62	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
63	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
64	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
65	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
66	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
67	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
68	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
69	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
70	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
71	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
72	300922	C 天秦	287	9,063.46	0.00
73	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
74	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
75	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
76	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
77	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603986	兆易创新	11,392,546,122.04	47.72
2	600703	三安光电	10,504,542,299.36	44.00
3	600745	闻泰科技	8,822,436,220.09	36.96
4	603160	汇顶科技	8,113,945,548.96	33.99
5	603501	韦尔股份	7,208,434,404.63	30.20
6	600584	长电科技	6,447,602,852.64	27.01
7	603019	中科曙光	4,267,736,993.33	17.88
8	600460	士兰微	2,807,135,565.21	11.76
9	600667	太极实业	2,694,319,912.03	11.29
10	300782	卓胜微	1,186,685,585.45	4.97
11	603005	晶方科技	479,182,097.37	2.01
12	002049	紫光国微	468,515,281.38	1.96
13	002371	北方华创	467,542,109.01	1.96
14	002129	中环股份	460,956,560.82	1.93
15	300661	圣邦股份	379,613,952.01	1.59
16	603290	斯达半导	375,817,145.93	1.57
17	002409	雅克科技	365,484,348.08	1.53
18	300223	北京君正	346,627,731.53	1.45
19	002185	华天科技	331,903,194.82	1.39
20	300346	南大光电	293,561,990.70	1.23

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

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603986	兆易创新	9,086,207,544.43	38.06
2	600703	三安光电	8,761,543,813.60	36.70
3	600745	闻泰科技	6,839,189,799.84	28.65
4	603160	汇顶科技	6,196,621,531.33	25.96
5	600584	长电科技	5,499,632,017.52	23.04
6	603501	韦尔股份	5,074,896,735.54	21.26
7	603019	中科曙光	3,953,862,222.33	16.56
8	600460	士兰微	2,371,885,957.10	9.94
9	600667	太极实业	2,189,993,745.71	9.17
10	002129	中环股份	456,170,688.69	1.91

11	002371	北方华创	395,784,796.42	1.66
12	002185	华天科技	361,113,659.19	1.51
13	002049	紫光国微	330,156,809.37	1.38
14	300661	圣邦股份	299,676,921.34	1.26
15	300316	晶盛机电	194,348,747.35	0.81
16	300327	中颖电子	188,436,768.24	0.79
17	002156	通富微电	154,361,208.39	0.65
18	300054	鼎龙股份	127,264,619.90	0.53
19	300236	上海新阳	118,335,640.04	0.50
20	300604	长川科技	110,150,737.39	0.46

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	68,984,622,549.85
卖出股票收入（成交）总额	53,329,980,237.12

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	15,293,000.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,293,000.00	0.06

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113616	韦尔转债	152,930	15,293,000.00	0.06

2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

##### 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	3,957,892.09
2	应收证券清算款	28,194,014.67
3	应收股利	-

4	应收利息	1,187,336.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,339,243.30

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600584	长电科技	190,487,979.00	0.80	转融通出借证券受限
2	600745	闻泰科技	182,209,500.00	0.76	转融通出借证券受限
3	603501	韦尔股份	149,586,000.00	0.63	非公开发行流通受限
4	002129	中环股份	131,493,300.00	0.55	转融通出借证券受限
5	002049	紫光国微	92,650,044.00	0.39	转融通出借证券受限
6	002371	北方华创	72,296,000.00	0.30	转融通出借证券受限
7	300782	卓胜微	65,155,668.00	0.27	转融通出借证券受限
8	300782	卓胜微	52,720,000.00	0.22	非公开发行流通受限
9	600745	闻泰科技	49,378,200.00	0.21	非公开发行流通受限
10	603501	韦尔股份	29,118,600.00	0.12	转融通出借证券受限
11	603986	兆易创新	12,245,000.00	0.05	转融通出借证券受限
12	603160	汇顶科技	3,111,000.00	0.01	转融通出借证券受限
13	600703	三安光电	1,755,650.00	0.01	转融通出借证券受限

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏国证半导体芯片 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
389,021	50,310.30	1,421,400,875.00	7.26%	15,234,172,949.00	77.84%	2,916,189,182.00	14.90%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	334,199,988.00	1.71%
2	中国人寿保险股份有限公司（台湾）—自有资金	135,060,200.00	0.69%
3	李葛卫	78,740,300.00	0.40%
4	BARCLAYS BANK PLC	75,794,175.00	0.39%
5	深圳前海富邦永业基金管理有限公司—富邦 1 号私募证券投资基金	65,000,000.00	0.33%
6	北京恒兆伟业投资有限公司	48,100,000.00	0.25%
7	申万宏源证券有限公司	45,749,454.00	0.23%
8	叶超英	45,627,700.00	0.23%
9	中国国际金融股份有限公司	44,986,528.00	0.23%
10	史浩	41,286,899.00	0.21%
11	中国建设银行股份有限公司—华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2,916,189,182.00	14.90%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	70,900.00	0.00%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年1月20日)基金份额总额	5,388,463,006.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	92,017,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	77,833,700,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	19,571,763,006.00

注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效。

## §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，本基金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

本基金管理人于 2020 年 4 月 1 日发布公告，张德根先生担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人于 2020 年 9 月 18 日发布公告，张霄岭先生不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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、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，根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等相关法律法规的规定，本基金修订基金合同等法律文件，投资范围增加存托凭证，并据此增加存托凭证的投资策略。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 80,000 元人民币。本基金本报告期内选聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

### 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

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关责令改正的行政监管措施，公司已按要求改正并报告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	
中信证券	10	52,800,852,421.51	43.18%	22,774,924.30	43.18%	-
光大证券	3	17,990,538,328.57	14.71%	7,759,556.61	14.71%	-
华西证券	1	11,474,361,369.19	9.38%	4,949,968.77	9.38%	-
浙商证券	1	9,827,904,052.52	8.04%	4,238,925.98	8.04%	-
国泰君安证券	2	8,980,831,312.46	7.34%	3,873,505.19	7.34%	-
中泰证券	2	7,609,408,584.71	6.22%	3,283,037.00	6.22%	-
中国银河证券	4	4,332,988,306.69	3.54%	1,868,887.45	3.54%	-
东北证券	1	3,743,349,916.75	3.06%	1,614,566.00	3.06%	-
东方证券	1	2,626,486,124.77	2.15%	1,132,803.92	2.15%	-
粤开证券	1	2,096,717,802.29	1.71%	904,318.19	1.71%	-
申万宏源证券	2	586,404,682.11	0.48%	254,027.49	0.48%	-
华泰证券	1	215,905,275.26	0.18%	93,120.16	0.18%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，除本表列示外，本基金还选择了安信证券、东兴证券、国盛证券、国泰君安、海通证券、申万宏源、万联证券、银河证券、中金公司、中信建投的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

### 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		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-
华西证券	-	-	190,000,000.00	8.94%
浙商证券	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	1,935,000,000.00	91.06%
中泰证券	13,917,246.53	100.00%	-	-
中国银河证券	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-

## 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	华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-21
2	华夏基金管理有限公司关于根据国家延长春节假期通知及交易所休市安排等调整旗下基金春节后业务办理日期的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-30
3	华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-05
4	华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-05
5	华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-05
6	华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-10
7	华夏基金管理有限公司关于调整华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-11
8	华夏基金管理有限公司关于华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-17
9	华夏基金管理有限公司关于华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-27
10	华夏基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金调整标的指数许可使用费并修订招募说明书的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-20

11	华夏基金管理有限公司关于旗下公募基金 2019 年年报延缓审计与披露的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-26
12	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-01
13	华夏基金管理有限公司关于调整华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-06-24
14	华夏基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-02
15	华夏基金管理有限公司关于华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-03
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-22
17	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-29
18	华夏基金管理有限公司关于上海分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-12
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-23
20	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-09-24
21	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-12
22	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-15
23	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-21
24	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-22
25	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-24
26	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-02
27	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-04
28	华夏基金管理有限公司关于华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-05
29	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-06
30	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-11-25
31	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2020-12-07

	联方承销证券的公告	网站	
32	华夏基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 新增华西证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-09
33	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-11
34	华夏基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-14
35	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-14
36	华夏基金管理有限公司关于调整华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金最小申购、赎回单位的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-14
37	华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-19
38	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-21

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可

在合理时间内取得备查文件的复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二一年三月三十日