
西藏东财中证 500 指数型发起式证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:西藏东财基金管理有限公司

基金托管人:中国国际金融股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2022年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年1月1日起至2022年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	57
7.1 期末基金资产组合情况	57
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	60
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	81
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	81
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	81
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	81
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	81
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	81
7.12 投资组合报告附注	81
§8 基金份额持有人信息	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	83
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	84
§9 开放式基金份额变动	84
§10 重大事件揭示	85
10.1 基金份额持有人大会决议	85
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
10.4 基金投资策略的改变	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
10.8 其他重大事件	86
§11 影响投资者决策的其他重要信息	87
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	87
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	87
§12 备查文件目录	87
12.1 备查文件目录	87
12.2 存放地点	88
12.3 查阅方式	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金	
基金简称	东财中证500	
基金主代码	010992	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年01月20日	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	中国国际金融股份有限公司	
报告期末基金份额总额	232,999,447.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财中证500A	东财中证500C
下属分级基金的交易代码	010992	010993
报告期末下属分级基金的份额总额	169,152,525.80份	63,846,921.63份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争获取与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金原则上采用完全复制标的指数的方法,进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。在正常市场情况下,本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预

	期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	西藏东财基金管理有限公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露负责人	姓名	沙福贵
	联系电话	021-23526999
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com
客户服务电话	400-9210-107	010-65353060；010-65351622
传真	021-23526940	010-65059873
注册地址	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼2层01室	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
邮政编码	200030	100004
法定代表人	戴彦	沈如军

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金中期报告备置地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	西藏东财基金管理有限公司	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	东财中证500A	东财中证500C
本期已实现收益	835,871.32	214,593.20
本期利润	-20,167,252.38	-8,756,945.93
加权平均基金份额本期利润	-0.1169	-0.1277
本期加权平均净值利润率	-11.24%	-12.34%
本期基金份额净值增长率	-10.07%	-10.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
	东财中证500A	东财中证500C
期末可供分配利润	11,615,562.80	3,991,248.12
期末可供分配基金份额利润	0.0687	0.0625
期末基金资产净值	180,768,088.60	67,838,169.75
期末基金份额净值	1.0687	1.0625
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
	东财中证500A	东财中证500C
基金份额累计净值增长率	6.87%	6.25%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东财中证500A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	7.86%	1.05%	6.74%	1.05%	1.12%	0.00%
过去三个月	3.65%	1.66%	1.99%	1.66%	1.66%	0.00%
过去六个月	-10.07%	1.55%	-11.65%	1.55%	1.58%	0.00%
过去一年	-0.35%	1.26%	-4.84%	1.26%	4.49%	0.00%
自基金合同 生效起至今	6.87%	1.16%	-0.18%	1.17%	7.05%	-0.01%

东财中证500C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	7.82%	1.05%	6.74%	1.05%	1.08%	0.00%
过去三个月	3.54%	1.66%	1.99%	1.66%	1.55%	0.00%
过去六个月	-10.25%	1.55%	-11.65%	1.55%	1.40%	0.00%
过去一年	-0.75%	1.26%	-4.84%	1.26%	4.09%	0.00%
自基金合同 生效起至今	6.25%	1.16%	-0.18%	1.17%	6.43%	-0.01%

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

东财中证500A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年01月20日-2022年06月30日)



东财中证500C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年01月20日-2022年06月30日)



注：1、本基金基金合同于2021年1月20日生效。

2、本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§ 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

西藏东财基金管理有限公司成立于2018年10月26日，是由东方财富证券股份有限公司全资设立的子公司，公司坚持投资人利益优先原则，致力于在合规管理、风险控制的基础上，以市场变化和客户需求为导向，努力发展成为一家有先进经营理念、清晰发展战略、优秀经营团队、前瞻性产品规划、严谨投资流程和强烈使命感的基金管理公司，为投资者提供高品质的专业资产管理服务。

截至2022年6月30日，公司旗下管理26只证券投资基金—西藏东财上证50指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财信息产业精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金、西藏东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证云计算与大数据主题指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财创新医疗六个月定期开放混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证芯片产业指数型发起式证券投资基金、西藏东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证食品饮料指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深创新药产业指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证新能源指数增强型证券投资基金、西藏东财数字经济优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金、西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、西藏东财品质生活优选混合型发起式证券投资基金。

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		

姚楠燕	本基金基金经理、西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证芯片产业指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证沪港深创新药产业指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证新能源指数增强型证券投资基金的基金经理、西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金的基金经理、西	2021-01-20	—	5 年	复旦大学经济学学士学位，美国南加利福尼亚大学公共政策硕士学位。自2013年8月始，先后在中欧国际工商学院、西藏东财基金管理有限公司筹备组、西藏东财基金管理有限公司担任金融学/会计学研究助理、筹备组成员、投资助理、基金经理助理兼研究员等职务。
-----	--	------------	---	-----	--

	藏东财上证50指数型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财信息产业精选混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、研究员				
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，本基金基金管理人公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易管理要求的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易行为进行监督检查，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金在运作过程中严格遵守法律法规和基金合同的要求，对基金采取完全被动复制的方式跟踪指数，控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差，力争获取与标的指数相似的投资收益。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是基金费用、申购赎回、交易成本、网下新股申购等因素。当申赎变动、成份股调整、成份股停牌等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，保持基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年06月30日，东财中证500A份额净值为1.0687元，报告期内基金份额净值增长率为-10.07%，东财中证500C份额净值为1.0625元，报告期内基金份额净值增长率为-10.25%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年上半年，国际环境更趋复杂严峻，国内疫情多发散发，经济下行压力进一步凸显。俄乌冲突趋于长期化，地区热点和地缘政治冲突有加剧趋势。受国际政治格局博弈和疫情对产业链供应链的影响，海外通胀持续高企，能源和粮食供应缺口持续引发多国社会动荡。为抑制通胀、稳定通胀预期和加快实际通胀水平向政策目标水平回落速度，

以美联储为代表的欧美发达国家央行继续加快收紧货币政策节奏，7月联储议息会议决定再次加息75bp，年内预计仍将维持收紧态势。

国内经济在经受住多个主要城市新冠疫情蔓延冲击后，经济总体呈现稳定恢复态势。上半年，按不变价计算，GDP同比增速达到2.5%，取得了来之不易的成绩。在统筹疫情防控和经济社会发展的背景下，财政政策继续靠前发力，专项债发行提速，重大基础设施项目陆续开工。货币政策继续保持稳健中性，同时加大银行信贷对实体经济的扶持力度。各项政策正逐步落地，政策效力正逐步发挥。

展望年内，随着美国中期选举等政治性事件在三四季度将趋于频繁，海外货币政策收紧面临更多权衡挑战，同时国内各项稳增长政策力求落实，经济高质量发展和转型升级步伐仍在加速，股票市场仍将具有投资机会，部分行业的结构性机会仍将凸显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值、基金资产净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布基金份额净值。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

本基金基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会。估值委员会会对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期末发生相关预警情形。

§ 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

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本基金托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	16,203,534.85	15,478,533.78
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	236,479,083.63	273,513,444.68
其中：股票投资		236,479,083.63	273,513,444.68
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		62,658.44	53,988.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,867.18
资产总计		252,745,276.92	289,048,834.28
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,797,149.50	825,755.51
应付管理人报酬		101,341.60	122,626.06
应付托管费		10,134.16	12,262.60
应付销售服务费		22,226.03	28,502.29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	455.61
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	208,167.28	148,951.81

负债合计		4,139,018.57	1,138,553.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	232,999,447.43	242,537,370.03
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	15,606,810.92	45,372,910.37
净资产合计		248,606,258.35	287,910,280.40
负债和净资产总计		252,745,276.92	289,048,834.28

注：报告截止日2022年6月30日，东财中证500A基金份额净值人民币1.0687元，基金份额总额169,152,525.80份；东财中证500C基金份额净值人民币1.0625元，基金份额总额63,846,921.63份。基金份额总额合计为232,999,447.43份。

6.2 利润表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月20日（基金 合同生效日）至2021 年06月30日
一、营业总收入		-28,001,659.93	25,961,260.80
1. 利息收入		36,438.64	101,829.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	36,438.64	101,829.71
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,927,916.64	12,045,669.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-753,103.92	9,149,177.35

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,681,020.56	2,896,492.48
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-29,974,662.83	13,803,161.68
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	8,647.62	10,599.58
减：二、营业总支出		922,538.38	1,857,667.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	621,311.92	847,924.22
2. 托管费	6.4.10.2. 2	62,131.19	84,792.42
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	140,981.15	230,273.23
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	98,114.12	694,677.61
三、利润总额（亏损总额		-28,924,198.31	24,103,593.32

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,924,198.31	24,103,593.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-28,924,198.31	24,103,593.32

注：本基金基金合同生效日为2021年1月20日，上年度实际可比期间为2021年1月20日至2021年6月30日。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	242,537,370.03	-	45,372,910.37	287,910,280.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	242,537,370.03	-	45,372,910.37	287,910,280.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,537,922.60	-	-29,766,099.45	-39,304,022.05
（一）、综合收益总额	-	-	-28,924,198.31	-28,924,198.31
（二）、本期基金份额交易产生的基金	-9,537,922.60	-	-841,901.14	-10,379,823.74

净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	61,097,687.14	-	2,887,254.16	63,984,941.30
2. 基金赎回款	-70,635,609.74	-	-3,729,155.30	-74,364,765.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	232,999,447.43	-	15,606,810.92	248,606,258.35
项 目	上年度可比期间 2021年01月20日(基金合同生效日)至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	405,219,850.31	-	-	405,219,850.31
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	405,219,850.31	-	-	405,219,850.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-83,870,552.40	-	23,077,062.71	-60,793,489.69
(一)、综合收益总额	-	-	24,103,593.32	24,103,593.32
(二)、本期基金份	-83,870,552.	-	-1,026,530.6	-84,897,083.

额交易产生的基金 净值变动数(净值减 少以“-”号填列)	40		1	01
其中: 1. 基金申购款	67,019,701.6 7	-	380,737.25	67,400,438.9 2
2. 基金赎回 款	-150,890,25 4.07	-	-1,407,267.8 6	-152,297,52 1.93
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的基金净值 变动(净值减少以 “-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收 益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	321,349,297. 91	-	23,077,062.7 1	344,426,360. 62

注: 本基金基金合同生效日为2021年1月20日, 上年度实际可比期间为2021年1月20日至2021年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

沙福贵

侯福岩

陆文澄

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人西藏东财基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)、《西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3222号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为405,219,850.31份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为

德师报（验）字（21）第00018号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2021年1月20日正式生效。本基金的基金管理人为西藏东财基金管理有限公司，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

根据《西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为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，基金还可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金股票资产投资比例为本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

6.4.4.1 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。本基金财务报表的实际编制期间为2022年1月1日至2022年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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分配的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/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币0元。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率逐日计提。

东财中证500A基金份额不收取销售服务费；东财中证500C基金份额的销售服务费按前一日该类别基金资产净值的0.40%年费率逐日计提。

本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

（1）对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

（2）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，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（3）根据《关于发布〈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〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

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

2. 增值税

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

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

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

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

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增

值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

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

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

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

5. 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
----	--------------------

活期存款	9,156,389.05
等于：本金	9,155,099.33
加：应计利息	1,289.72
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	7,047,145.80
等于：本金	7,046,066.49
加：应计利息	1,079.31
减：坏账准备	-
合计	16,203,534.85

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		247,460,217.93	-	236,479,083.63	-10,981,134.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	247,460,217.93	-	236,479,083.63	-10,981,134.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	162.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	11,900.75
预提费用-信息披露费	169,507.37
其他应付	26,596.51
合计	208,167.28

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东财中证500A

金额单位：人民币元

项目 (东财中证500A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	171,939,440.28	171,939,440.28
本期申购	41,989,322.76	41,989,322.76
本期赎回（以“-”号填列）	-44,776,237.24	-44,776,237.24
本期末	169,152,525.80	169,152,525.80

6.4.7.7.2 东财中证500C

金额单位：人民币元

项目 (东财中证500C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,597,929.75	70,597,929.75
本期申购	19,108,364.38	19,108,364.38
本期赎回（以“-”号填列）	-25,859,372.50	-25,859,372.50
本期末	63,846,921.63	63,846,921.63

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东财中证500A

单位：人民币元

项目 (东财中证500A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	22,227,472.12	10,163,191.12	32,390,663.24
本期利润	835,871.32	-21,003,123.70	-20,167,252.38
本期基金份额交易产生的变动数	-358,590.32	-249,257.74	-607,848.06

其中：基金申购款	5,592,898.32	-3,616,476.80	1,976,421.52
基金赎回款	-5,951,488.64	3,367,219.06	-2,584,269.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,704,753.12	-11,089,190.32	11,615,562.80

6.4.7.8.2 东财中证500C

单位：人民币元

项目 (东财中证500C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,815,337.61	4,166,909.52	12,982,247.13
本期利润	214,593.20	-8,971,539.13	-8,756,945.93
本期基金份额交易产生的变动数	-874,068.91	640,015.83	-234,053.08
其中：基金申购款	2,442,109.37	-1,531,276.73	910,832.64
基金赎回款	-3,316,178.28	2,171,292.56	-1,144,885.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,155,861.90	-4,164,613.78	3,991,248.12

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	23,800.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12,638.16
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	36,438.64

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	68,634,957.54
减：卖出股票成本总额	69,178,953.62
减：交易费用	209,107.84
买卖股票差价收入	-753,103.92

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,681,020.56
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,681,020.56

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-29,974,662.83
——股票投资	-29,974,662.83
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——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	-29,974,662.83

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	8,600.45
转换费收入	47.17
合计	8,647.62

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	1,853.55
指数使用费	24,852.45
合计	98,114.12

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
西藏东财基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金托管人
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商
上海天天基金销售有限公司（“天天基金”）	与管理人受同一实际控制人控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月20日（基金合同生效日） 至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
东财证券	120,710,013.65	100.00%	616,672,457.12	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
东财证券	108,006.58	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

		例		
东财证券	367,523.59	100.00%	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年01月20日（基金合同 生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	621,311.92	847,924.22
其中：支付销售机构的客户维护费	295,745.33	410,956.48

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年01月20日（基金合同生 效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	62,131.19	84,792.42

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财中证500A	东财中证500C	合计
上海天天 基金销售 有限公司	0.00	110,393.38	110,393.38
东方财富 证券股份 有限公司	0.00	27,639.57	27,639.57
合计	0.00	138,032.95	138,032.95
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财中证500A	东财中证500C	合计
上海天天 基金销售 有限公司	0.00	178,438.59	178,438.59
东方财富 证券股份 有限公司	0.00	48,095.85	48,095.85
合计	0.00	226,534.44	226,534.44

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

东财中证500A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01 日至2022年06 月30日	上年度可比期间 2021年01月20日（基金 合同生效日）至2021年0 6月30日
基金合同生效日（2021年01月20日）持有的基金份额	0.00	10,000,458.38
报告期初持有的基金份额	10,000,458.38	0.00
报告期间申购/买入总份额	899,361.45	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,899,819.83	10,000,458.38
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.44%	4.60%

东财中证500C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01 日至2022年06 月30日	上年度可比期间 2021年01月20日（基金 合同生效日）至2021年0 6月30日
基金合同生效日（2021年01月20日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：本基金基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月20日（基金合同生效日） 至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中金证券-托管户	9,156,389.05	23,800.48	11,546,319.88	52,009.41
东财证券-证券资金户	7,047,145.80	12,638.16	10,630,087.39	49,820.30

注：1、本基金的银行存款存放在托管人中金公司在招商银行股份有限公司开立的托管账户中，本基金本报告期内无源自本基金托管人中金公司的银行存款及利息收入。

2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于东财证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2022-04-12	6个月	科创板新股限售	71.88	139.78	1,484	106,669.92	207,433.52	-
688197	首药控股	2022-03-16	6个月	科创板新股限售	39.90	23.20	8,664	345,693.60	201,004.80	-
688279	峰岬科技	2022-04-13	6个月	科创板新股限售	82.00	67.34	2,478	203,196.00	166,868.52	-
688290	景业智能	2022-04-21	6个月	科创板新股限售	33.89	46.87	3,040	103,025.60	142,484.80	-

				售						
688251	井松智能	2022-05-27	6个月	科创板新股限售	35.62	36.66	3,392	120,823.04	124,350.72	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	38.46	38.46	3,051	117,341.46	117,341.46	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	3.82	3.82	27,706	105,836.92	105,836.92	-
688237	超卓航科	2022-06-24	5个交易日	新股未上市	41.27	41.27	2,402	99,130.54	99,130.54	-
688325	赛微微电	2022-04-15	6个月	科创板新股限售	74.55	53.89	1,836	136,873.80	98,942.04	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	9个交易日	新股未上市	33.65	33.65	2,873	96,676.45	96,676.45	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,576	65,435.52	65,435.52	-
688171	纬德信息	2022-01-20	6个月	科创板新股限售	28.68	22.77	2,821	80,906.28	64,234.17	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	创业板新股限售	3.80	6.39	3,331	12,657.80	21,285.09	-
3012	瑞泰	2022	6个	创业	19.1	32.0	659	12,6	21,1	-

38	新材	-06-10	月	板新股限售	8	7		39.62	34.13	
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月	创业板新股限售	26.86	47.07	419	11,254.34	19,722.33	-
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	创业板新股限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月	创业板新股限售	27.53	45.04	328	9,029.84	14,773.12	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	创业板新股限售	45.13	54.11	272	12,275.36	14,717.92	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	创业板新股限售	16.91	19.79	669	11,312.79	13,239.51	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6个月	创业板新股限售	19.93	31.38	421	8,390.53	13,210.98	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月	创业板新股限售	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月	创业板新股限售	17.27	14.83	868	14,990.36	12,872.44	-

				售						
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月	创业板新股限售	72.69	71.54	177	12,866.13	12,662.58	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月	创业板新股限售	39.30	37.93	333	13,086.90	12,630.69	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	创业板新股限售	21.33	22.54	555	11,838.15	12,509.70	-
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	创业板新股限售	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	创业板新股限售	28.50	34.87	344	9,804.00	11,995.28	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	创业板新股限售	52.03	56.42	212	11,030.36	11,961.04	-
301116	益客食品	2022-01-10	6个月	创业板新股限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	创业板新股限售	33.68	43.98	259	8,723.12	11,390.82	-
3012	亚香	2022	6个	创业	35.9	39.1	285	10,2	11,1	-

20	股份	-06-15	月	板新股限售	8	5		54.30	57.75	
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	创业板新股限售	29.67	33.28	333	9,880.11	11,082.24	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月	创业板新股限售	8.05	10.08	1,066	8,581.30	10,745.28	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月	创业板新股限售	52.37	47.83	214	11,207.18	10,235.62	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月	创业板新股限售	72.88	31.38	312	15,159.04	9,790.56	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6个月	创业板新股限售	39.07	29.87	319	12,463.33	9,528.53	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月	创业板新股限售	15.37	15.99	571	8,776.27	9,130.29	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	创业板新股限售	34.81	16.14	561	13,018.94	9,054.54	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	创业板新股限售	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-

				售						
3011 25	腾亚 精工	2022 -05- 27	6个 月	创业 板新 股限 售	22.4 9	27.4 2	327	7,35 4.23	8,96 6.34	-
3011 63	宏德 股份	2022 -04- 11	6个 月	创业 板新 股限 售	26.2 7	32.3 3	277	7,27 6.79	8,95 5.41	-
3011 30	西点 药业	2022 -02- 16	6个 月	创业 板新 股限 售	22.5 5	37.7 0	237	5,34 4.35	8,93 4.90	-
3012 06	三元 生物	2022 -01- 26	6个 月	创业 板新 股限 售	109. 30	45.6 9	195	14,2 09.0 0	8,90 9.55	-
3012 00	大族 数控	2022 -02- 18	6个 月	创业 板新 股限 售	76.5 6	51.9 2	166	12,7 08.9 6	8,61 8.72	-
3011 03	何氏 眼科	2022 -03- 14	6个 月	创业 板新 股限 售	42.5 0	32.0 2	267	8,71 2.50	8,54 9.34	-
3012 07	华兰 疫苗	2022 -02- 10	6个 月	创业 板新 股限 售	56.8 8	56.4 2	147	8,36 1.36	8,29 3.74	-
3011 48	嘉戎 技术	2022 -04- 14	6个 月	创业 板新 股限 售	38.3 9	23.9 0	329	12,6 30.3 1	7,86 3.10	-
3011	兆讯	2022	6个	创业	39.8	31.0	243	9,69	7,55	-

02	传媒	-03-15	月	板新股限售	8	9		0.84	4.87	
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月	创业板新股限售	33.98	28.96	254	8,630.92	7,355.84	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	创业板新股限售	31.98	26.26	270	8,634.60	7,090.20	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月	创业板新股限售	48.30	41.68	159	7,679.70	6,627.12	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6个月	创业板新股限售	56.69	41.86	157	8,900.33	6,572.02	-
301279	金道科技	2022-04-06	6个月	创业板新股限售	31.20	22.81	280	8,736.00	6,386.80	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	创业板新股限售	173.98	87.82	72	6,959.20	6,323.04	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月	创业板新股限售	37.23	25.39	248	9,233.04	6,296.72	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	创业板新股限售	30.82	21.46	286	8,814.52	6,137.56	-

				售						
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	创业板新股限售	40.25	30.59	198	7,969.50	6,056.82	-
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月	创业板新股限售	55.57	30.03	174	9,669.18	5,225.22	-
301110	青木股份	2022-03-04	6个月	创业板新股限售	63.10	39.85	129	8,139.90	5,140.65	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	创业板新股限售	64.08	37.52	98	6,279.84	3,676.96	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022-06-01	重大事项停牌	9.60	2022-07-14	9.99	45,600	437,895.80	437,760.00	-

注：本基金截至2022年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数基金，采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。若因标的指数编制方法调整，或预期成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、合规审计委员会、风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了投资银行存款白名单，通过对存款银行的信用评估来控制银行存款信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指开放式基金未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因投资品种交易不活跃而出现的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情況下以合理的价格变现投资。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,203,534.85	-	-	-	16,203,534.85
交易性金融资产	-	-	-	236,479,083.63	236,479,083.63
应收申购款	-	-	-	62,658.44	62,658.44
资产总计	16,203,534.85	-	-	236,541,742.07	252,745,276.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,797,149.50	3,797,149.50
应付管理人报酬	-	-	-	101,341.60	101,341.60
应付托管费	-	-	-	10,134.16	10,134.16
应付销售服务费	-	-	-	22,226.03	22,226.03

其他负债	-	-	-	208,167.28	208,167.28
负债总计	-	-	-	4,139,018.57	4,139,018.57
利率敏感度缺口	16,203,534.85	-	-	232,402,723.50	248,606,258.35
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,478,533.78	-	-	-	15,478,533.78
交易性金融资产	-	-	-	273,513,444.68	273,513,444.68
应收利息	-	-	-	2,867.18	2,867.18
应收申购款	-	-	-	53,988.64	53,988.64
资产总计	15,478,533.78	-	-	273,570,300.50	289,048,834.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	825,755.51	825,755.51
应付管理人报酬	-	-	-	122,626.06	122,626.06
应付托管费	-	-	-	12,262.60	12,262.60
应付销售服务费	-	-	-	28,502.29	28,502.29
应交税费	-	-	-	455.61	455.61
其他负债	-	-	-	148,951.81	148,951.81
负债总计	-	-	-	1,138,553.88	1,138,553.88
利率敏感度缺口	15,478,533.78	-	-	272,431,746.62	287,910,280.40

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资，按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	236,479,083.63	95.12	273,513,444.68	95.00
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	236,479,083.63	95.12	273,513,444.68	95.00

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	12,307,990.50	13,824,407.21
	业绩比较基准下降5%	-12,307,990.50	-13,824,407.21

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2022年06月30日	2021年12月31日
第一层次	234,055,144.51	271,504,675.54
第二层次	922,180.89	713,623.07
第三层次	1,501,758.23	1,295,146.07
合计	236,479,083.63	273,513,444.68

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021年12月31日：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	236,479,083.63	93.56
	其中：股票	236,479,083.63	93.56
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,203,534.85	6.41
8	其他各项资产	62,658.44	0.02
9	合计	252,745,276.92	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,146,727.60	0.86
B	采矿业	10,405,158.80	4.19
C	制造业	139,317,514.83	56.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,220,396.00	2.90
E	建筑业	3,025,161.00	1.22
F	批发和零售业	9,040,887.00	3.64
G	交通运输、仓储和邮政业	6,240,942.80	2.51
H	住宿和餐饮业	494,487.20	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,299,729.46	6.96
J	金融业	20,757,982.36	8.35
K	房地产业	5,533,125.73	2.23
L	租赁和商务服务业	2,831,456.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	2,921,797.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	1,703,068.00	0.69

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	547,360.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	3,129,941.00	1.26
S	综合	1,716,649.00	0.69
	合计	234,332,383.78	94.26

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,319,684.68	0.53
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	23,180.94	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	509,915.71	0.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,554.87	0.00
M	科学研究和技术服务业	46,337.28	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	134,800.58	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	105,225.79	0.04

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,146,699.85	0.86

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	600522	中天科技	97,001	2,240,723.10	0.90
2	601615	明阳智能	59,800	2,021,240.00	0.81
3	600256	广汇能源	163,200	1,720,128.00	0.69
4	300769	德方纳米	3,700	1,512,116.00	0.61
5	600096	云天化	45,600	1,435,488.00	0.58
6	300012	华测检测	59,700	1,385,637.00	0.56
7	002497	雅化集团	40,900	1,335,385.00	0.54
8	002407	多氟多	27,200	1,330,352.00	0.54
9	002240	盛新锂能	21,500	1,297,740.00	0.52
10	300390	天华超净	14,600	1,276,040.00	0.51
11	002180	纳思达	25,100	1,270,562.00	0.51
12	600157	永泰能源	789,000	1,254,510.00	0.50
13	600885	宏发股份	29,680	1,242,108.00	0.50
14	000009	中国宝安	91,600	1,235,684.00	0.50
15	600141	兴发集团	27,600	1,214,124.00	0.49
16	300073	当升科技	12,600	1,138,284.00	0.46
17	600392	盛和资源	49,800	1,125,480.00	0.45
18	002384	东山精密	48,600	1,114,398.00	0.45

19	603613	国联股份	12,375	1,096,425.00	0.44
20	002756	永兴材料	7,200	1,095,912.00	0.44
21	600418	江淮汽车	62,000	1,063,920.00	0.43
22	300285	国瓷材料	28,500	1,023,720.00	0.41
23	600765	中航重机	31,360	1,009,164.80	0.41
24	600399	抚顺特钢	56,000	1,002,400.00	0.40
25	600233	圆通速递	48,800	995,032.00	0.40
26	601555	东吴证券	142,260	985,861.80	0.40
27	600563	法拉电子	4,800	984,768.00	0.40
28	601058	赛轮轮胎	86,982	980,287.14	0.39
29	600487	亨通光电	67,100	975,634.00	0.39
30	000983	山西焦煤	72,700	973,453.00	0.39
31	300037	新宙邦	18,440	969,206.40	0.39
32	600499	科达制造	46,900	968,016.00	0.39
33	600732	爱旭股份	29,300	967,486.00	0.39
34	603077	和邦生物	219,500	935,070.00	0.38
35	688180	君实生物	12,277	924,949.18	0.37
36	603456	九洲药业	17,800	920,260.00	0.37
37	002385	大北农	117,600	918,456.00	0.37
38	688122	西部超导	9,954	917,758.80	0.37
39	601108	财通证券	115,400	908,198.00	0.37
40	300363	博腾股份	11,600	904,684.00	0.36
41	002268	卫 士 通	21,000	901,110.00	0.36
42	688099	晶晨股份	8,796	888,396.00	0.36
43	600486	扬农化工	6,600	879,648.00	0.35
44	603345	安井食品	5,200	872,924.00	0.35
45	600298	安琪酵母	17,774	866,482.50	0.35
46	000519	中兵红箭	29,700	865,755.00	0.35
47	300144	宋城演艺	55,700	854,995.00	0.34
48	000630	铜陵有色	261,700	853,142.00	0.34
49	600862	中航高科	29,700	834,570.00	0.34

50	000988	华工科技	35,700	827,169.00	0.33
51	603605	珀莱雅	5,000	825,900.00	0.33
52	002353	杰瑞股份	20,400	822,120.00	0.33
53	000783	长江证券	137,500	815,375.00	0.33
54	601077	渝农商行	219,800	813,260.00	0.33
55	601168	西部矿业	67,700	800,891.00	0.32
56	002625	光启技术	45,900	792,693.00	0.32
57	601696	中银证券	59,200	787,360.00	0.32
58	300146	汤臣倍健	36,200	783,730.00	0.32
59	601162	天风证券	246,200	782,916.00	0.31
60	300724	捷佳伟创	8,700	777,345.00	0.31
61	688777	中控技术	10,672	776,494.72	0.31
62	002028	思源电气	21,700	773,822.00	0.31
63	002056	横店东磁	28,900	769,318.00	0.31
64	002797	第一创业	119,400	765,354.00	0.31
65	002507	涪陵榨菜	22,100	762,892.00	0.31
66	603517	绝味食品	13,100	757,442.00	0.30
67	600988	赤峰黄金	47,264	753,860.80	0.30
68	603589	口子窖	12,800	750,208.00	0.30
69	000932	华菱钢铁	147,200	749,248.00	0.30
70	002185	华天科技	79,700	747,586.00	0.30
71	601128	常熟银行	97,300	743,372.00	0.30
72	601636	旗滨集团	57,200	729,300.00	0.29
73	603026	石大胜华	5,000	726,750.00	0.29
74	600521	华海药业	31,900	724,130.00	0.29
75	002603	以岭药业	29,655	720,616.50	0.29
76	600039	四川路桥	68,200	718,146.00	0.29
77	002326	永太科技	21,800	717,874.00	0.29
78	600109	国金证券	79,400	714,600.00	0.29
79	601607	上海医药	39,400	712,352.00	0.29
80	000830	鲁西化工	40,900	707,161.00	0.28

81	002078	太阳纸业	57,200	704,132.00	0.28
82	688390	固德威	2,247	703,333.47	0.28
83	605117	德业股份	2,500	699,725.00	0.28
84	002624	完美世界	48,200	692,634.00	0.28
85	600153	建发股份	52,900	691,403.00	0.28
86	600546	山煤国际	35,200	684,992.00	0.28
87	603939	益丰药房	12,800	676,224.00	0.27
88	603267	鸿远电子	5,000	671,650.00	0.27
89	601872	招商轮船	115,200	663,552.00	0.27
90	002422	科伦药业	35,400	661,980.00	0.27
91	600348	华阳股份	42,700	660,142.00	0.27
92	000738	航发控制	23,400	657,540.00	0.26
93	600705	中航产融	190,000	657,400.00	0.26
94	600497	驰宏锌锗	126,600	657,054.00	0.26
95	601990	南京证券	78,500	654,690.00	0.26
96	600177	雅戈尔	98,600	653,718.00	0.26
97	000831	五矿稀土	20,900	653,125.00	0.26
98	600549	厦门钨业	30,200	652,924.00	0.26
99	600875	东方电气	39,500	649,775.00	0.26
100	603127	昭衍新药	5,700	648,660.00	0.26
101	000970	中科三环	34,520	648,285.60	0.26
102	300699	光威复材	11,000	647,570.00	0.26
103	300088	长信科技	87,200	647,024.00	0.26
104	300676	华大基因	8,800	630,960.00	0.25
105	000999	华润三九	14,000	630,000.00	0.25
106	600160	巨化股份	47,900	629,885.00	0.25
107	600859	王府井	24,100	626,118.00	0.25
108	002572	索菲亚	22,700	624,250.00	0.25
109	002138	顺络电子	22,900	624,025.00	0.25
110	000998	隆平高科	37,400	623,084.00	0.25
111	002673	西部证券	95,200	622,608.00	0.25

112	601699	潞安环能	42,500	621,350.00	0.25
113	600516	方大炭素	81,100	616,360.00	0.25
114	002557	洽洽食品	10,800	614,844.00	0.25
115	600143	金发科技	64,000	609,280.00	0.25
116	000807	云铝股份	61,600	608,608.00	0.24
117	002508	老板电器	16,800	605,304.00	0.24
118	000039	中集集团	43,600	603,860.00	0.24
119	601997	贵阳银行	103,900	603,659.00	0.24
120	600482	中国动力	38,400	603,264.00	0.24
121	002030	达安基因	34,840	598,899.60	0.24
122	002273	水晶光电	49,430	598,597.30	0.24
123	000960	锡业股份	35,600	597,012.00	0.24
124	002465	海格通信	65,500	595,395.00	0.24
125	603444	吉比特	1,500	582,000.00	0.23
126	000629	攀钢钒钛	152,700	580,260.00	0.23
127	300136	信维通信	34,400	579,640.00	0.23
128	000728	国元证券	93,000	578,460.00	0.23
129	300058	蓝色光标	88,500	577,905.00	0.23
130	300357	我武生物	11,106	577,845.18	0.23
131	000975	银泰黄金	59,200	576,608.00	0.23
132	600170	上海建工	189,700	574,791.00	0.23
133	600536	中国软件	14,030	569,477.70	0.23
134	002092	中泰化学	73,200	568,032.00	0.23
135	600704	物产中大	110,700	567,891.00	0.23
136	601577	长沙银行	71,400	566,202.00	0.23
137	689009	九号公司	12,640	562,480.00	0.23
138	002409	雅克科技	10,100	560,651.00	0.23
139	600079	人福医药	34,800	556,800.00	0.22
140	002294	信立泰	19,800	556,380.00	0.22
141	600739	辽宁成大	38,000	554,040.00	0.22
142	603198	迎驾贡酒	8,500	553,690.00	0.22

143	300474	景嘉微	8,050	550,539.50	0.22
144	002223	鱼跃医疗	21,400	549,124.00	0.22
145	300244	迪安诊断	17,600	547,360.00	0.22
146	000547	航天发展	45,600	544,464.00	0.22
147	300418	昆仑万维	34,000	544,000.00	0.22
148	002372	伟星新材	22,600	543,304.00	0.22
149	600415	小商品城	97,500	543,075.00	0.22
150	000636	风华高科	28,800	541,152.00	0.22
151	300558	贝达药业	8,900	541,120.00	0.22
152	002506	协鑫集成	145,400	540,888.00	0.22
153	002739	万达电影	39,600	540,540.00	0.22
154	300253	卫宁健康	61,000	535,580.00	0.22
155	600699	均胜电子	34,000	534,140.00	0.21
156	600372	中航电子	27,400	531,286.00	0.21
157	300308	中际旭创	17,000	527,850.00	0.21
158	300296	利亚德	72,200	527,060.00	0.21
159	600637	东方明珠	72,700	519,805.00	0.21
160	002683	广东宏大	18,600	517,638.00	0.21
161	600315	上海家化	12,100	517,275.00	0.21
162	600867	通化东宝	50,000	517,000.00	0.21
163	601016	节能风电	106,800	512,640.00	0.21
164	600985	淮北矿业	35,200	512,512.00	0.21
165	600236	桂冠电力	84,000	511,560.00	0.21
166	601198	东兴证券	57,400	510,860.00	0.21
167	000887	中鼎股份	28,000	510,720.00	0.21
168	600026	中远海能	49,400	510,302.00	0.21
169	002299	圣农发展	26,500	508,270.00	0.20
170	002156	通富微电	33,000	508,200.00	0.20
171	600171	上海贝岭	20,200	505,606.00	0.20
172	300832	新产业	11,200	505,232.00	0.20
173	002065	东华软件	79,700	503,704.00	0.20

174	600380	健康元	40,700	502,645.00	0.20
175	600879	航天电子	77,200	501,028.00	0.20
176	688185	康希诺	2,512	500,088.96	0.20
177	600642	申能股份	87,200	495,296.00	0.20
178	600258	首旅酒店	19,939	494,487.20	0.20
179	300026	红日药业	64,000	492,800.00	0.20
180	002936	郑州银行	182,590	491,167.10	0.20
181	000750	国海证券	135,300	491,139.00	0.20
182	002408	齐翔腾达	60,540	490,979.40	0.20
183	000623	吉林敖东	33,000	487,080.00	0.20
184	002203	海亮股份	41,900	483,945.00	0.19
185	000729	燕京啤酒	50,000	483,000.00	0.19
186	000400	许继电气	25,100	481,920.00	0.19
187	000513	丽珠集团	13,300	481,593.00	0.19
188	600673	东阳光	53,500	480,965.00	0.19
189	000878	云南铜业	42,200	480,658.00	0.19
190	600820	隧道股份	78,200	478,584.00	0.19
191	600038	中直股份	10,500	474,600.00	0.19
192	600529	山东药玻	16,900	472,355.00	0.19
193	600801	华新水泥	24,200	472,142.00	0.19
194	600580	卧龙电驱	32,700	471,534.00	0.19
195	601717	郑煤机	32,700	471,207.00	0.19
196	002439	启明星辰	23,600	470,348.00	0.19
197	600369	西南证券	118,000	468,460.00	0.19
198	300017	网宿科技	86,900	465,784.00	0.19
199	300383	光环新网	44,700	465,774.00	0.19
200	002183	怡亚通	64,600	465,766.00	0.19
201	002131	利欧股份	239,900	465,406.00	0.19
202	603568	伟明环保	13,900	463,843.00	0.19
203	600316	洪都航空	15,300	462,672.00	0.19
204	600166	福田汽车	163,400	462,422.00	0.19

205	600848	上海临港	34,000	461,040.00	0.19
206	688256	寒武纪	7,109	459,952.30	0.19
207	002444	巨星科技	24,400	459,696.00	0.18
208	002958	青农商行	138,100	458,492.00	0.18
209	002195	二三四五	203,300	457,425.00	0.18
210	600909	华安证券	100,040	455,182.00	0.18
211	600027	华电国际	115,800	455,094.00	0.18
212	600325	华发股份	60,100	454,957.00	0.18
213	601005	重庆钢铁	238,100	454,771.00	0.18
214	600008	首创环保	156,400	453,560.00	0.18
215	300001	特锐德	25,900	448,329.00	0.18
216	300618	寒锐钴业	7,700	445,984.00	0.18
217	300024	机器人	44,000	443,520.00	0.18
218	000825	太钢不锈	80,900	440,905.00	0.18
219	002500	山西证券	76,500	439,110.00	0.18
220	002926	华西证券	55,900	438,256.00	0.18
221	002670	国盛金控	45,600	437,760.00	0.18
222	002430	杭氧股份	14,000	437,640.00	0.18
223	002373	千方科技	39,300	437,016.00	0.18
224	603218	日月股份	17,200	436,880.00	0.18
225	688521	芯原股份	8,843	436,844.20	0.18
226	000050	深天马 A	43,600	434,692.00	0.17
227	000027	深圳能源	67,600	433,316.00	0.17
228	600271	航天信息	39,500	432,130.00	0.17
229	000739	普洛药业	20,900	431,376.00	0.17
230	002250	联化科技	26,200	428,894.00	0.17
231	002212	天融信	42,100	427,315.00	0.17
232	600863	内蒙华电	115,900	423,035.00	0.17
233	603233	大参林	13,500	422,550.00	0.17
234	601866	中远海发	140,800	422,400.00	0.17
235	600118	中国卫星	21,000	421,680.00	0.17

236	600208	新湖中宝	152,700	421,452.00	0.17
237	300677	英科医疗	16,440	416,918.40	0.17
238	688009	中国通号	91,839	416,030.67	0.17
239	002985	北摩高科	7,078	414,629.24	0.17
240	000060	中金岭南	92,900	414,334.00	0.17
241	002249	大洋电机	67,200	412,608.00	0.17
242	300009	安科生物	40,740	411,881.40	0.17
243	601992	金隅集团	148,100	410,237.00	0.17
244	000778	新兴铸管	85,000	409,700.00	0.16
245	603156	养元饮品	18,022	409,459.84	0.16
246	002152	广电运通	44,100	408,807.00	0.16
247	600066	宇通客车	47,200	408,280.00	0.16
248	603658	安图生物	8,300	405,787.00	0.16
249	300070	碧水源	77,200	402,212.00	0.16
250	300182	捷成股份	73,100	402,050.00	0.16
251	603858	步长制药	20,300	400,113.00	0.16
252	300168	万达信息	42,200	398,368.00	0.16
253	000401	冀东水泥	37,800	397,656.00	0.16
254	002966	苏州银行	65,070	396,927.00	0.16
255	600998	九州通	33,300	396,603.00	0.16
256	300251	光线传媒	41,700	394,899.00	0.16
257	600056	中国医药	26,520	393,026.40	0.16
258	002191	劲嘉股份	36,600	392,352.00	0.16
259	002128	电投能源	27,300	390,936.00	0.16
260	600390	五矿资本	79,900	390,711.00	0.16
261	002831	裕同科技	13,200	390,060.00	0.16
262	600970	中材国际	40,200	389,538.00	0.16
263	000997	新大陆	29,300	387,053.00	0.16
264	600667	太极实业	52,400	386,712.00	0.16
265	000021	深科技	33,200	386,448.00	0.16
266	300482	万孚生物	9,490	386,337.90	0.16

267	002505	鹏都农牧	113,200	383,748.00	0.15
268	002244	滨江集团	44,200	382,330.00	0.15
269	002221	东华能源	41,000	381,710.00	0.15
270	600021	上海电力	37,200	381,300.00	0.15
271	600528	中铁工业	47,300	380,765.00	0.15
272	600062	华润双鹤	14,800	379,768.00	0.15
273	688002	睿创微纳	9,560	379,723.20	0.15
274	000656	金科股份	132,700	379,522.00	0.15
275	600839	四川长虹	131,100	377,568.00	0.15
276	600827	百联股份	28,500	376,485.00	0.15
277	603885	吉祥航空	20,900	375,991.00	0.15
278	600297	广汇汽车	144,000	375,840.00	0.15
279	002396	星网锐捷	16,600	375,824.00	0.15
280	000987	越秀金控	53,440	375,683.20	0.15
281	600598	北大荒	25,300	373,428.00	0.15
282	603707	健友股份	13,230	373,086.00	0.15
283	002127	南极电商	69,700	372,198.00	0.15
284	002019	亿帆医药	26,300	367,674.00	0.15
285	600201	生物股份	40,000	366,400.00	0.15
286	600498	烽火通信	25,300	366,344.00	0.15
287	600155	华创阳安	43,200	366,336.00	0.15
288	002266	浙富控股	76,300	365,477.00	0.15
289	600259	广晟有色	7,200	364,680.00	0.15
290	002155	湖南黄金	29,900	362,986.00	0.15
291	000012	南玻A	48,800	362,096.00	0.15
292	600409	三友化工	44,000	360,360.00	0.14
293	000930	中粮科技	39,700	358,888.00	0.14
294	600511	国药股份	13,400	358,852.00	0.14
295	000883	湖北能源	70,000	357,700.00	0.14
296	600718	东软集团	30,900	355,659.00	0.14
297	002153	石基信息	22,380	355,170.60	0.14

298	600755	厦门国贸	46,900	351,750.00	0.14
299	002124	天邦食品	52,280	351,321.60	0.14
300	002511	中顺洁柔	28,000	350,560.00	0.14
301	000686	东北证券	49,900	348,801.00	0.14
302	600060	海信视像	27,900	348,750.00	0.14
303	600959	江苏有线	106,500	347,190.00	0.14
304	603712	七一二	11,000	346,500.00	0.14
305	600282	南钢股份	109,400	344,610.00	0.14
306	000581	威孚高科	17,800	342,650.00	0.14
307	600895	张江高科	27,500	342,375.00	0.14
308	600782	新钢股份	67,908	342,256.32	0.14
309	600566	济川药业	12,600	342,216.00	0.14
310	601880	辽港股份	200,600	341,020.00	0.14
311	000709	河钢股份	150,860	340,943.60	0.14
312	601179	中国西电	72,800	340,704.00	0.14
313	000690	宝新能源	77,300	338,574.00	0.14
314	600022	山东钢铁	194,400	338,256.00	0.14
315	600064	南京高科	30,745	338,195.00	0.14
316	600535	天士力	32,000	336,320.00	0.14
317	002939	长城证券	33,100	336,296.00	0.14
318	300376	易事特	41,100	333,732.00	0.13
319	601778	晶科科技	61,700	333,180.00	0.13
320	002701	奥瑞金	64,000	332,800.00	0.13
321	002002	鸿达兴业	88,700	329,077.00	0.13
322	600216	浙江医药	24,000	327,600.00	0.13
323	300630	普利制药	9,300	326,895.00	0.13
324	600500	中化国际	49,100	326,515.00	0.13
325	600808	马钢股份	85,800	325,182.00	0.13
326	000598	兴蓉环境	63,600	324,996.00	0.13
327	600037	歌华有线	34,600	324,894.00	0.13
328	600663	陆家嘴	31,300	324,268.00	0.13

329	002468	申通快递	27,200	324,224.00	0.13
330	002532	天山铝业	49,600	323,888.00	0.13
331	600728	佳都科技	49,900	322,354.00	0.13
332	688188	柏楚电子	1,453	319,718.12	0.13
333	688208	道通科技	9,668	318,270.56	0.13
334	600567	山鹰国际	114,700	317,719.00	0.13
335	002595	豪迈科技	14,200	317,228.00	0.13
336	600517	国网英大	60,900	316,071.00	0.13
337	603225	新凤鸣	27,200	313,888.00	0.13
338	002004	华邦健康	56,200	313,596.00	0.13
339	603866	桃李面包	18,948	313,589.40	0.13
340	601456	国联证券	25,500	312,885.00	0.13
341	688289	圣湘生物	10,531	311,822.91	0.13
342	300463	迈克生物	15,200	311,448.00	0.13
343	000785	居然之家	69,600	309,720.00	0.12
344	600597	光明乳业	24,500	309,435.00	0.12
345	002429	兆驰股份	80,400	308,736.00	0.12
346	002745	木林森	31,600	308,732.00	0.12
347	300115	长盈精密	29,880	308,062.80	0.12
348	688006	杭可科技	4,346	304,480.76	0.12
349	601958	金钼股份	34,400	304,096.00	0.12
350	300166	东方国信	32,700	301,494.00	0.12
351	300888	稳健医疗	4,500	299,250.00	0.12
352	601106	中国一重	97,400	299,018.00	0.12
353	002390	信邦制药	43,200	298,512.00	0.12
354	601860	紫金银行	104,000	298,480.00	0.12
355	300072	三聚环保	58,400	295,504.00	0.12
356	603927	中科软	12,620	294,298.40	0.12
357	600572	康恩贝	66,300	293,709.00	0.12
358	600398	海澜之家	61,400	291,650.00	0.12
359	601118	海南橡胶	60,800	290,624.00	0.12

360	601718	际华集团	93,600	290,160.00	0.12
361	600507	方大特钢	41,447	289,714.53	0.12
362	000540	中天金融	149,300	288,149.00	0.12
363	600737	中粮糖业	38,000	285,760.00	0.11
364	603883	老百姓	8,320	281,881.60	0.11
365	600582	天地科技	58,800	281,064.00	0.11
366	000089	深圳机场	36,400	281,008.00	0.11
367	000937	冀中能源	37,600	280,496.00	0.11
368	000559	万向钱潮	46,900	278,586.00	0.11
369	002048	宁波华翔	17,300	277,146.00	0.11
370	600967	内蒙一机	30,300	276,336.00	0.11
371	002368	太极股份	14,365	275,951.65	0.11
372	000898	鞍钢股份	85,100	274,022.00	0.11
373	600871	石化油服	144,600	273,294.00	0.11
374	600435	北方导航	31,700	273,254.00	0.11
375	601000	唐山港	105,200	271,416.00	0.11
376	001914	招商积余	15,100	271,347.00	0.11
377	002690	美亚光电	12,510	271,216.80	0.11
378	601568	北元集团	42,360	268,562.40	0.11
379	002110	三钢闽光	43,500	264,915.00	0.11
380	600195	中牧股份	21,600	264,816.00	0.11
381	600556	天下秀	32,100	264,183.00	0.11
382	000959	首钢股份	55,500	264,180.00	0.11
383	601333	广深铁路	120,400	262,472.00	0.11
384	000156	华数传媒	32,900	262,213.00	0.11
385	002233	塔牌集团	29,600	261,960.00	0.11
386	002281	光迅科技	14,900	261,942.00	0.11
387	688321	微芯生物	10,285	259,079.15	0.10
388	600811	东方集团	91,000	257,530.00	0.10
389	002705	新宝股份	11,700	257,283.00	0.10
390	000537	广宇发展	19,800	257,202.00	0.10

391	003035	南网能源	40,400	256,540.00	0.10
392	002010	传化智联	39,800	255,914.00	0.10
393	600764	中国海防	10,100	254,924.00	0.10
394	002174	游族网络	26,000	254,020.00	0.10
395	000402	金融街	42,500	252,875.00	0.10
396	600329	达仁堂	10,200	250,716.00	0.10
397	600120	浙江东方	61,710	247,457.10	0.10
398	300212	易华录	14,200	247,080.00	0.10
399	603638	艾迪精密	12,000	246,000.00	0.10
400	600126	杭钢股份	48,000	245,760.00	0.10
401	002416	爱施德	26,400	245,520.00	0.10
402	000488	晨鸣纸业	43,500	245,340.00	0.10
403	600167	联美控股	32,500	243,425.00	0.10
404	000990	诚志股份	22,200	243,090.00	0.10
405	600446	金证股份	23,400	242,892.00	0.10
406	601200	上海环境	23,900	242,824.00	0.10
407	002867	周大生	15,550	241,491.50	0.10
408	000685	中山公用	31,400	241,152.00	0.10
409	002081	金螳螂	47,400	240,792.00	0.10
410	600373	中文传媒	24,100	240,759.00	0.10
411	601098	中南传媒	25,500	240,720.00	0.10
412	002925	盈趣科技	11,100	238,872.00	0.10
413	002382	蓝帆医疗	25,000	238,750.00	0.10
414	600707	彩虹股份	51,000	238,680.00	0.10
415	000158	常山北明	39,700	238,200.00	0.10
416	601611	中国核建	28,200	236,598.00	0.10
417	001965	招商公路	30,700	234,241.00	0.09
418	002146	荣盛发展	77,200	233,916.00	0.09
419	002399	海普瑞	13,300	233,814.00	0.09
420	600095	湘财股份	30,400	233,776.00	0.09
421	601608	中信重工	61,600	233,464.00	0.09

422	603317	天味食品	8,120	231,176.40	0.09
423	002387	维信诺	34,400	231,168.00	0.09
424	000967	盈峰环境	45,200	228,712.00	0.09
425	600131	国网信通	17,000	228,650.00	0.09
426	688088	虹软科技	7,203	227,542.77	0.09
427	002948	青岛银行	62,600	226,612.00	0.09
428	688029	南微医学	2,595	226,284.00	0.09
429	000528	柳 工	34,700	225,897.00	0.09
430	600376	首开股份	45,803	224,892.73	0.09
431	601187	厦门银行	37,500	223,500.00	0.09
432	600623	华谊集团	26,800	222,440.00	0.09
433	603000	人民网	19,600	219,520.00	0.09
434	000563	陕国投 A	70,343	219,470.16	0.09
435	002423	中粮资本	32,700	219,417.00	0.09
436	600901	江苏租赁	42,400	217,512.00	0.09
437	601598	中国外运	56,000	217,280.00	0.09
438	600307	酒钢宏兴	111,200	215,728.00	0.09
439	600006	东风汽车	28,400	214,420.00	0.09
440	601991	大唐发电	88,000	213,840.00	0.09
441	603228	景旺电子	9,100	212,303.00	0.09
442	300257	开山股份	14,100	210,936.00	0.08
443	603650	彤程新材	6,400	208,512.00	0.08
444	000961	中南建设	67,900	207,095.00	0.08
445	600906	财达证券	23,000	206,770.00	0.08
446	600717	天津港	51,380	206,033.80	0.08
447	002242	九阳股份	10,900	200,124.00	0.08
448	002434	万里扬	23,300	199,215.00	0.08
449	000718	苏宁环球	53,900	198,352.00	0.08
450	601928	凤凰传媒	27,100	193,765.00	0.08
451	000671	阳 光 城	88,200	193,158.00	0.08
452	000415	渤海租赁	87,800	190,526.00	0.08

453	000553	安道麦A	15,500	187,705.00	0.08
454	601969	海南矿业	21,700	186,403.00	0.07
455	600968	海油发展	72,200	186,276.00	0.07
456	000031	大悦城	45,700	182,800.00	0.07
457	600648	外高桥	13,300	180,880.00	0.07
458	600787	中储股份	31,100	176,959.00	0.07
459	600928	西安银行	47,300	173,591.00	0.07
460	600339	中油工程	59,500	171,955.00	0.07
461	002563	森马服饰	28,700	169,904.00	0.07
462	601228	广州港	44,000	161,480.00	0.06
463	300869	康泰医学	5,700	161,082.00	0.06
464	002815	崇达技术	12,400	158,844.00	0.06
465	600835	上海机电	11,500	157,895.00	0.06
466	000028	国药一致	5,300	157,887.00	0.06
467	688819	天能股份	4,409	152,463.22	0.06
468	600377	宁沪高速	17,600	150,832.00	0.06
469	000717	韶钢松山	43,000	150,500.00	0.06
470	002945	华林证券	9,600	146,400.00	0.06
471	603056	德邦股份	10,900	146,387.00	0.06
472	603379	三美股份	6,500	144,625.00	0.06
473	000869	张裕A	4,800	142,752.00	0.06
474	601139	深圳燃气	20,400	141,576.00	0.06
475	000062	深圳华强	11,100	140,970.00	0.06
476	600299	安迪苏	14,300	136,994.00	0.06
477	601298	青岛港	24,900	136,203.00	0.05
478	601869	长飞光纤	4,300	132,956.00	0.05
479	603868	飞科电器	1,700	128,775.00	0.05
480	001872	招商港口	8,000	124,800.00	0.05
481	601156	东航物流	6,200	122,760.00	0.05
482	002653	海思科	7,600	122,436.00	0.05
483	300741	华宝股份	4,400	122,408.00	0.05

484	600823	世茂股份	40,000	119,200.00	0.05
485	600350	山东高速	22,200	116,550.00	0.05
486	601828	美凯龙	19,200	116,352.00	0.05
487	600927	永安期货	5,700	114,969.00	0.05
488	001227	兰州银行	22,200	109,224.00	0.04
489	603355	莱克电气	4,080	102,938.40	0.04
490	603786	科博达	1,600	98,512.00	0.04
491	603515	欧普照明	5,400	94,230.00	0.04
492	001203	大中矿业	8,000	90,400.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	17,900	87,352.00	0.04
494	002946	新乳业	6,200	80,538.00	0.03
495	603719	良品铺子	2,800	80,164.00	0.03
496	601003	柳钢股份	18,200	73,710.00	0.03
497	002901	大博医疗	1,600	62,624.00	0.03
498	600956	新天绿能	5,000	61,600.00	0.02
499	603983	丸美股份	1,900	50,920.00	0.02
500	600917	重庆燃气	6,100	44,042.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688072	拓荆科技	1,484	207,433.52	0.08
2	688197	首药控股	8,664	201,004.80	0.08
3	688279	峰岬科技	2,478	166,868.52	0.07
4	688290	景业智能	3,040	142,484.80	0.06
5	688251	井松智能	3,392	124,350.72	0.05
6	301139	元道通信	3,051	117,341.46	0.05
7	301175	中科环保	27,706	105,836.92	0.04
8	688237	超卓航科	2,402	99,130.54	0.04
9	688325	赛微微电	1,836	98,942.04	0.04

10	301239	普瑞眼科	2,873	96,676.45	0.04
11	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.03
12	688171	纬德信息	2,821	64,234.17	0.03
13	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
14	300953	震裕科技	240	32,877.60	0.01
15	301215	中汽股份	3,331	21,285.09	0.01
16	301238	瑞泰新材	659	21,134.13	0.01
17	301266	宇邦新材	419	19,722.33	0.01
18	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.01
19	301112	信邦智能	328	14,773.12	0.01
20	301162	国能日新	272	14,717.92	0.01
21	301286	侨源股份	669	13,239.51	0.01
22	301263	泰恩康	421	13,210.98	0.01
23	301298	东利机械	634	13,206.22	0.01
24	301217	铜冠铜箔	868	12,872.44	0.01
25	301201	诚达药业	177	12,662.58	0.01
26	301235	华康医疗	333	12,630.69	0.01
27	301187	欧圣电气	555	12,509.70	0.01
28	301091	深城交	455	12,421.50	0.00
29	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
30	301268	铭利达	344	11,995.28	0.00
31	301302	华如科技	212	11,961.04	0.00
32	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
33	301153	中科江南	259	11,390.82	0.00
34	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
35	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
36	301212	联盛化学	333	11,082.24	0.00
37	301256	华融化学	1,066	10,745.28	0.00
38	300763	锦浪科技	50	10,650.00	0.00
39	301097	天益医疗	214	10,235.62	0.00
40	301015	百洋医药	462	9,969.96	0.00

41	301236	软通动力	312	9,790.56	0.00
42	301248	杰创智能	319	9,528.53	0.00
43	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
44	301137	哈焊华通	571	9,130.29	0.00
45	301109	军信股份	561	9,054.54	0.00
46	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
47	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
48	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
49	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
50	301206	三元生物	195	8,909.55	0.00
51	301200	大族数控	166	8,618.72	0.00
52	301103	何氏眼科	267	8,549.34	0.00
53	301207	华兰疫苗	147	8,293.74	0.00
54	301148	嘉戎技术	329	7,863.10	0.00
55	301102	兆讯传媒	243	7,554.87	0.00
56	301222	浙江恒威	254	7,355.84	0.00
57	301135	瑞德智能	270	7,090.20	0.00
58	301258	富士莱	159	6,627.12	0.00
59	301237	和顺科技	157	6,572.02	0.00
60	301279	金道科技	280	6,386.80	0.00
61	301219	腾远钴业	72	6,323.04	0.00
62	301123	奕东电子	248	6,296.72	0.00
63	301151	冠龙节能	286	6,137.56	0.00
64	301181	标榜股份	198	6,056.82	0.00
65	300971	博亚精工	245	6,039.25	0.00
66	300952	恒辉安防	340	5,916.00	0.00
67	605358	立昂微	84	5,659.92	0.00
68	301057	汇隆新材	218	5,308.30	0.00
69	300834	星辉环材	174	5,225.22	0.00
70	301110	青木股份	129	5,140.65	0.00
71	301016	雷尔伟	275	5,128.75	0.00

72	301007	德迈仕	303	4,566.21	0.00
73	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
74	301196	唯科科技	98	3,676.96	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600096	云天化	1,463,963.94	0.51
2	300769	德方纳米	1,447,711.00	0.50
3	300012	华测检测	1,388,207.00	0.48
4	002497	雅化集团	1,348,135.00	0.47
5	002240	盛新锂能	1,311,104.00	0.46
6	300390	天华超净	1,115,103.00	0.39
7	002407	多氟多	1,112,851.00	0.39
8	600188	兖矿能源	1,102,459.00	0.38
9	688180	君实生物	1,073,400.75	0.37
10	300073	当升科技	1,028,065.00	0.36
11	002756	永兴材料	1,009,645.00	0.35
12	601058	赛轮轮胎	1,003,437.14	0.35
13	688122	西部超导	910,840.58	0.32
14	601108	财通证券	899,031.00	0.31
15	688777	中控技术	878,521.70	0.31
16	000783	长江证券	824,980.00	0.29
17	601696	中银证券	811,392.00	0.28
18	601162	天风证券	809,888.00	0.28
19	600499	科达制造	804,226.00	0.28
20	002625	光启技术	755,708.87	0.26

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000733	振华科技	1,798,939.00	0.62
2	002340	格林美	1,591,559.00	0.55
3	600188	兖矿能源	1,525,692.00	0.53
4	300751	迈为股份	1,289,185.00	0.45
5	601117	中国化学	1,261,761.00	0.44
6	000723	美锦能源	1,248,243.00	0.43
7	600884	杉杉股份	1,141,351.00	0.40
8	688005	容百科技	1,119,793.02	0.39
9	601689	拓普集团	1,035,628.00	0.36
10	605358	立昂微	1,010,493.96	0.35
11	002013	中航机电	971,428.00	0.34
12	300763	锦浪科技	968,195.00	0.34
13	600754	锦江酒店	966,851.00	0.34
14	688327	云从科技	804,816.36	0.28
15	300223	北京君正	714,738.00	0.25
16	600733	北汽蓝谷	702,409.00	0.24
17	688536	思瑞浦	691,201.51	0.24
18	603290	斯达半导	669,004.00	0.23
19	002080	中材科技	634,296.00	0.22
20	600803	新奥股份	631,485.00	0.22

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	62,119,255.40
卖出股票收入（成交）总额	68,634,957.54

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	62,658.44
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	62,658.44

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情 况说明
1	688072	拓荆科技	207,433.52	0.08	科创板新股 限售
2	688197	首药控股	201,004.80	0.08	科创板新股 限售
3	688279	峰昭科技	166,868.52	0.07	科创板新股 限售
4	688290	景业智能	142,484.80	0.06	科创板新股 限售
5	688251	井松智能	124,350.72	0.05	科创板新股 限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
东财 中证5 00A	11,176	15,135.34	11,024,215.34	6.52%	158,128,310.46	93.48%
东财 中证5 00C	5,764	11,076.84	481.19	0.00%	63,846,440.44	100.00%
合计	16,068	14,500.84	11,024,696.53	4.73%	221,974,750.90	95.27%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东财中证500A	9,028.94	0.01%
	东财中证500C	72.85	0.00%
	合计	9,101.79	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资	东财中证500A	0~10

和研究部门负责人持有本开放式基金	东财中证500C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东财中证500A	0
	东财中证500C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,899,819.83	4.68%	10,000,458.38	4.29%	3年
基金管理人高级管理人员	8,965.09	0.00%	0.00	0.00%	—
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
合计	10,908,784.92	4.68%	10,000,458.38	4.29%	3年

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东财中证500A	东财中证500C
基金合同生效日(2021年01月20日)基金份额总额	266,643,478.48	138,576,371.83
本报告期期初基金份额总额	171,939,440.28	70,597,929.75
本报告期基金总申购份额	41,989,322.76	19,108,364.38
减：本报告期基金总赎回份额	44,776,237.24	25,859,372.50
本报告期基金拆分变动份额	—	—

本报告期期末基金份额总额	169, 152, 525. 80	63, 846, 921. 63
--------------	-------------------	------------------

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生重大变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金基金管理人及其高级管理人员、基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

东财 证券	2	120,710,013.65	100.0 0%	108,006.58	100.0 0%	-
----------	---	----------------	-------------	------------	-------------	---

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与中信证券、中信证券华南、中信证券山东及中信期货认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-20
2	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2021年第四季度报告	证监会规定网站	2022-01-21
3	西藏东财基金管理有限公司关于提示投资者持续完善客户身份信息的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-25
4	西藏东财基金管理有限公司关于更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-27
5	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与蚂蚁(杭州)基金销售有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-28
6	关于公司自有资金拟申购旗下权益类公募基金相关事宜的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-29
7	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与上海联泰	证监会规定报刊和网站	2022-03-11

	基金销售有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告		
8	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2021年年度报告	证监会规定网站	2022-03-29
9	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与北京雪球基金销售有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022-04-13
10	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2022年第一季度报告	证监会规定网站	2022-04-21
11	西藏东财基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“神火股份”股票估值方法的公告	证监会规定报刊和网站	2022-04-30
12	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与浙江同花顺基金销售有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022-06-17

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金募集注册的文件
- 二、《西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》
- 三、《西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

西藏东财基金管理有限公司
二〇二二年八月三十日