
西藏东财沪深 300 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:国信证券股份有限公司

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。

基金托管人国信证券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3月15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	8
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本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)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
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	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64

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	65
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	65
§9 开放式基金份额变动	66
§10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金	
基金简称	东财沪深300指数发起式	
基金主代码	015278	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年03月15日	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	国信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	22,463,304.58份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财沪深300指数发起式A	东财沪深300指数发起式C
下属分级基金的交易代码	015278	015279
报告期末下属分级基金的份额总额	16,635,375.35份	5,827,929.23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	沪深300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	国信证券股份有限公司
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	0755-61897778
传真	021-23526940	0755-22940165
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	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码	200030	518000
法定代表人	戴彦	张纳沙

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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03月15日(基金合同生效日)-2022年06月30日)	
	东财沪深300指数 发起式A	东财沪深300指数 发起式C
本期已实现收益	190,575.98	64,127.10
本期利润	1,979,177.64	743,023.15
加权平均基金份额本期利润	0.1175	0.1085
本期加权平均净值利润率	11.58%	10.71%
本期基金份额净值增长率	11.91%	11.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	191,616.74	60,096.71
期末可供分配基金份额利润	0.0115	0.0103
期末基金资产净值	18,616,346.67	6,514,255.56
期末基金份额净值	1.1191	1.1178
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	11.91%	11.78%

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。

4、本基金的基金合同生效日为2022年3月15日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2022年6月30日数据，特此说明。

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

东财沪深300指数发起式A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.74%	1.01%	9.12%	1.02%	0.62%	-0.01%
过去三个月	11.85%	0.82%	5.93%	1.36%	5.92%	-0.54%
自基金合同生效起至今	11.91%	0.75%	7.10%	1.50%	4.81%	-0.75%

东财沪深300指数发起式C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.71%	1.01%	9.12%	1.02%	0.59%	-0.01%
过去三个月	11.74%	0.82%	5.93%	1.36%	5.81%	-0.54%
自基金合同生效起至今	11.78%	0.75%	7.10%	1.50%	4.68%	-0.75%

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

东财沪深300指数发起式A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年03月15日-2022年06月30日)



东财沪深300指数发起式C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年03月15日-2022年06月30日)



注：1、本基金基金合同于2022年3月15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		

吴逸	本基金基金经理、西藏东财上证50指数型发起式证券投资基金的基金经理、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、西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金的基金经理、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、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、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、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、量化投资部总监、研究部总监	2022-03-15	-	12年	上海财经大学经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。自2010年6月开始，先后在天治基金管理有限公司、东方财富信息股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、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产品创新及量化投资部总监助理、筹备组成员、资产管理总部投资主办人、量化投资部总监、研究部总监等职务。
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	2022-03-15	-	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

<p>金的基金经理、西藏东财中证500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</p>			<p>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。</p>
---	--	--	--

	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《证券投资基金管理公司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，东财沪深300指数发起式A份额净值为1.1191元，报告期内基金份额净值增长率为11.91%，东财沪深300指数发起式C份额净值为1.1178元，报告期内基金份额净值增长率为11.78%，同期业绩比较基准收益率为7.10%。

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

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

本基金本报告期未进行利润分配，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

本基金本报告期未发生相关预警情形。

§ 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

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“本基金托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

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

本基金托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：西藏东财沪深300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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	1,556,126.23
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	23,836,997.04
其中：股票投资		23,836,997.04
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		17,931.84
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		25,411,055.11
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30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		261,688.55
应付管理人报酬		9,981.16
应付托管费		998.11
应付销售服务费		2,202.82
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	5,582.24
负债合计		280,452.88
净资产:		
实收基金	6.4.7.7	22,463,304.58
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	2,667,297.65
净资产合计		25,130,602.23
负债和净资产总计		25,411,055.11

注：1、报告截止日2022年6月30日，东财沪深300指数发起式A基金份额净值人民币1.1191元，基金份额总额16,635,375.35份；东财沪深300指数发起式C基金份额净值人民币1.1178元，基金份额总额5,827,929.23份。基金份额总额合计为22,463,304.58份。

2、本基金基金合同生效日为2022年3月15日，本期是指2022年3月15日至2022年6月30日。

6.2 利润表

会计主体：西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金

本报告期：2022年03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年03月15日（基金合同 生效日）至2022年06月30 日
一、营业总收入		2,775,034.26
1. 利息收入		20,703.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	20,703.94
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）		286,324.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	74,167.07
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	212,157.81
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	2,467,497.71

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	507.73
减：二、营业总支出		52,833.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	35,218.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,521.91
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,144.86
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	5,947.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,722,200.79
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,722,200.79
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,722,200.79

注：本基金基金合同生效日为2022年3月15日，本期是指2022年3月15日至2022年6月30日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金

本报告期：2022年03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月15日（基金合同生效日）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）	24,031,169.38	-	-	24,031,169.38
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)	24,031,169.38	-	-	24,031,169.38
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,567,864.80	-	2,667,297.65	1,099,432.85
(一)、综合收益总额	-	-	2,722,200.79	2,722,200.79
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,567,864.80	-	-54,903.14	-1,622,767.94
其中: 1. 基金申购款	1,311,178.26	-	95,417.52	1,406,595.78
2. 基金赎回款	-2,879,043.06	-	-150,320.66	-3,029,363.72
(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)	22,463,304.58	-	2,667,297.65	25,130,602.23

注: 本基金基金合同生效日为2022年3月15日, 本期是指2022年3月15日至2022年6月30日, 无上年度可比期间数据。

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

西藏东财沪深300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《西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财沪深300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[2022]314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24,031,169.38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（22）第00134号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2022年3月15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，基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《西藏东财沪深300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，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册上市的股票、存托凭证）、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。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存

出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深300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3月15日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

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3月15日（基金合同生效日）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。

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。

东财沪深300指数发起式A基金份额不收取销售服务费；东财沪深300指数发起式C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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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		883,341.23
等于：本金		883,110.41
加：应计利息		230.82
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		672,785.00
等于：本金		672,682.92
加：应计利息		102.08
减：坏账准备		-
合计		1,556,126.23

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	21,369,499.33	-	23,836,997.04	2,467,497.71
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	21,369,499.33	-	23,836,997.04	2,467,497.71

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	34.28
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	5,547.96
合计	5,582.24

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东财沪深300指数发起式A

金额单位：人民币元

项目 (东财沪深300指数发起式A)	本期 2022年03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	16,949,872.90	16,949,872.90
本期申购	815,796.61	815,796.61
本期赎回（以“-”号填列）	-1,130,294.16	-1,130,294.16
本期末	16,635,375.35	16,635,375.35

6.4.7.7.2 东财沪深300指数发起式C

金额单位：人民币元

项目 (东财沪深300指数发起式C)	本期 2022年03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,081,296.48	7,081,296.48
本期申购	495,381.65	495,381.65
本期赎回（以“-”号填列）	-1,748,748.90	-1,748,748.90
本期末	5,827,929.23	5,827,929.23

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

2、本基金自2022年3月2日至2022年3月11日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币24,027,765.95元（其中A类16,948,004.24元，C类7,079,761.71元）。根据《西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同/招募说明书/基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币3,403.43元（其中A类1,868.66元，C类1,534.77元），在本基金成立后，折算为24,031,169.38份基金份额（其中A类16,949,872.90份，C类7,081,296.48份），划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东财沪深300指数发起式A

单位：人民币元

项目 (东财沪深300指数发起式A)	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	190,575.98	1,788,601.66	1,979,177.64
本期基金份额交易产生的变动数	1,040.76	752.92	1,793.68
其中：基金申购款	5,556.44	53,982.20	59,538.64
基金赎回款	-4,515.68	-53,229.28	-57,744.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	191,616.74	1,789,354.58	1,980,971.32

6.4.7.8.2 东财沪深300指数发起式C

单位：人民币元

项目 (东财沪深300指数发起式C)	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	64,127.10	678,896.05	743,023.15
本期基金份额交易产生的变动数	-4,030.39	-52,666.43	-56,696.82
其中：基金申购款	2,872.44	33,006.44	35,878.88
基金赎回款	-6,902.83	-85,672.87	-92,575.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,096.71	626,229.62	686,326.33

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
活期存款利息收入	4,715.33

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	15,988.61
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	20,703.94

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03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
卖出股票成交总额	3,082,433.66
减：卖出股票成本总额	2,986,046.30
减：交易费用	22,220.29
买卖股票差价收入	74,167.07

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03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	212,157.81
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	212,157.81

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03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	2,467,497.71
——股票投资	2,467,497.71
——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	2,467,497.71

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
基金赎回费收入	418.18

转换费收入	89.55
合计	507.73

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03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
审计费用	5,547.96
信息披露费	-
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	5,947.96

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
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金托管人、基金销售机构、基金证券经纪商
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
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03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国信证券	27,424,178.77	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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03月15日（基金合同生效日）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
国信证券	16,930.82	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03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	35,218.74
其中：支付销售机构的客户维护费	10,174.55

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03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,521.91

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03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财沪深300指数发起式A	东财沪深300指数发起式C	合计
上海天天 基金销售 有限公司	0.00	6,506.91	6,506.91
东方财富 证券股份 有限公司	0.00	1,448.61	1,448.61
国信证券 股份有限 公司	0.00	2.66	2.66
合计	0.00	7,958.18	7,958.18

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0.4%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：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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

本基金本报告期末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

东财沪深300指数发起式A

份额单位：份

项目	本期 2022年03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
基金合同生效日（2022年03月15日）持有的基金份额	10,000,500.05
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,500.05
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	60.12%

东财沪深300指数发起式C

份额单位：份

项目	本期 2022年03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日
基金合同生效日（2022年03月15日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

例

注：1、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。

2、本基金基金合同生效日为2022年3月15日，本期是指2022年3月15日至2022年6月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：1、本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

2、本基金基金合同生效日为2022年3月15日，本期是指2022年3月15日至2022年6月30日，无上年度可比期间数据。

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03月15日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
国信证券-托管户	883,341.23	4,715.33
国信证券-证券资金户	672,785.00	15,988.61

注：1、本基金的银行存款存放在托管人国信证券在交通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国信证券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国信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

本基金本报告期未进行利润分配。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金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。

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况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	1,556,126.23	-	-	-	1,556,126.23
交易性金融资产	-	-	-	23,836,997.04	23,836,997.04
应收申购款	-	-	-	17,931.84	17,931.84
资产总计	1,556,126.23	-	-	23,854,928.88	25,411,055.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	261,688.55	261,688.55

应付管理人报酬	-	-	-	9,981.16	9,981.16
应付托管费	-	-	-	998.11	998.11
应付销售服务费	-	-	-	2,202.82	2,202.82
其他负债	-	-	-	5,582.24	5,582.24
负债总计	-	-	-	280,452.88	280,452.88
利率敏感度缺口	1,556,126.23	-	-	23,574,476.00	25,130,602.23

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。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	23,836,997.04	94.85
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	23,836,997.04	94.85

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
	业绩比较基准上升5%	420,888.08
	业绩比较基准下降5%	-420,888.08

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 2022年06月30日
第一层次	23,836,997.04
第二层次	-
第三层次	-
合计	23,836,997.04

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

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	23,836,997.04	93.81
	其中：股票	23,836,997.04	93.81
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	1,556,126.23	6.12
8	其他各项资产	17,931.84	0.07
9	合计	25,411,055.11	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	289,292.00	1.15
B	采矿业	669,058.00	2.66
C	制造业	14,135,526.94	56.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	603,204.00	2.40
E	建筑业	466,163.00	1.85
F	批发和零售业	62,152.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	629,721.00	2.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	739,641.32	2.94

J	金融业	4,826,413.68	19.21
K	房地产业	444,572.00	1.77
L	租赁和商务服务业	334,291.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	364,979.00	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,159.00	0.05
Q	卫生和社会工作	215,884.00	0.86
R	文化、体育和娱乐业	26,688.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	23,819,744.94	94.78

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	15,370.50	0.06
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	1,252.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	629.60	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,252.10	0.07

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	600519	贵州茅台	700	1,431,500.00	5.70
2	300750	宁德时代	1,600	854,400.00	3.40
3	600036	招商银行	14,100	595,020.00	2.37
4	601318	中国平安	12,400	578,956.00	2.30
5	601012	隆基绿能	6,860	457,081.80	1.82
6	000858	五粮液	2,200	444,246.00	1.77
7	000333	美的集团	5,600	338,184.00	1.35
8	002594	比亚迪	1,000	333,490.00	1.33
9	601166	兴业银行	16,600	330,340.00	1.31
10	300059	东方财富	12,060	306,324.00	1.22
11	600900	长江电力	13,000	300,560.00	1.20
12	601888	中国中免	1,100	256,223.00	1.02

13	600030	中信证券	11,200	242,592.00	0.97
14	603259	药明康德	2,300	239,177.00	0.95
15	600887	伊利股份	5,800	225,910.00	0.90
16	000568	泸州老窖	800	197,232.00	0.78
17	600809	山西汾酒	600	194,880.00	0.78
18	002415	海康威视	5,300	191,860.00	0.76
19	601398	工商银行	40,100	191,277.00	0.76
20	002475	立讯精密	5,600	189,224.00	0.75
21	600276	恒瑞医药	5,100	189,159.00	0.75
22	600438	通威股份	3,100	185,566.00	0.74
23	000651	格力电器	5,400	182,088.00	0.72
24	600309	万华化学	1,800	174,582.00	0.69
25	000725	京东方 A	42,900	169,026.00	0.67
26	000001	平安银行	11,100	166,278.00	0.66
27	002714	牧原股份	3,000	165,810.00	0.66
28	002142	宁波银行	4,500	161,145.00	0.64
29	000002	万科 A	7,700	157,850.00	0.63
30	601328	交通银行	31,500	156,870.00	0.62
31	300760	迈瑞医疗	500	156,600.00	0.62
32	002129	TCL中环	2,600	153,114.00	0.61
33	601899	紫金矿业	16,400	153,012.00	0.61
34	002812	恩捷股份	600	150,270.00	0.60
35	002466	天齐锂业	1,200	149,760.00	0.60
36	000792	盐湖股份	4,900	146,804.00	0.58
37	600048	保利发展	8,100	141,426.00	0.56
38	603799	华友钴业	1,460	139,605.20	0.56
39	300015	爱尔眼科	3,100	138,787.00	0.55
40	300124	汇川技术	2,100	138,327.00	0.55
41	603288	海天味业	1,530	138,250.80	0.55
42	002460	赣锋锂业	900	133,830.00	0.53
43	002304	洋河股份	700	128,205.00	0.51

44	600031	三一重工	6,700	127,702.00	0.51
45	601668	中国建筑	24,000	127,680.00	0.51
46	300014	亿纬锂能	1,300	126,750.00	0.50
47	300498	温氏股份	5,800	123,482.00	0.49
48	601088	中国神华	3,700	123,210.00	0.49
49	002352	顺丰控股	2,200	122,782.00	0.49
50	002271	东方雨虹	2,300	118,381.00	0.47
51	600690	海尔智家	4,300	118,078.00	0.47
52	300274	阳光电源	1,200	117,900.00	0.47
53	600089	特变电工	4,300	117,777.00	0.47
54	603986	兆易创新	800	113,768.00	0.45
55	601816	京沪高铁	22,500	112,950.00	0.45
56	601288	农业银行	36,500	110,230.00	0.44
57	600837	海通证券	11,000	107,910.00	0.43
58	600000	浦发银行	13,400	107,334.00	0.43
59	600436	片仔癀	300	107,019.00	0.43
60	600016	民生银行	28,300	105,276.00	0.42
61	603501	韦尔股份	600	103,818.00	0.41
62	600406	国电南瑞	3,840	103,680.00	0.41
63	688981	中芯国际	2,229	100,683.93	0.40
64	601919	中远海控	7,200	100,080.00	0.40
65	300122	智飞生物	900	99,909.00	0.40
66	000625	长安汽车	5,590	96,818.80	0.39
67	600919	江苏银行	13,500	96,120.00	0.38
68	600585	海螺水泥	2,700	95,256.00	0.38
69	601688	华泰证券	6,700	95,140.00	0.38
70	002049	紫光国微	500	94,860.00	0.38
71	600104	上汽集团	5,300	94,393.00	0.38
72	000661	长春高新	400	93,368.00	0.37
73	601225	陕西煤业	4,400	93,192.00	0.37
74	002709	天赐材料	1,500	93,090.00	0.37

75	000063	中兴通讯	3,600	91,908.00	0.37
76	601601	中国太保	3,900	91,767.00	0.37
77	002241	歌尔股份	2,700	90,720.00	0.36
78	600111	北方稀土	2,500	87,900.00	0.35
79	300142	沃森生物	1,800	87,102.00	0.35
80	002230	科大讯飞	2,100	86,562.00	0.34
81	002371	北方华创	300	83,136.00	0.33
82	688599	天合光能	1,250	81,562.50	0.32
83	002459	晶澳科技	1,020	80,478.00	0.32
84	601988	中国银行	24,100	78,566.00	0.31
85	002027	分众传媒	11,600	78,068.00	0.31
86	601211	国泰君安	5,100	77,520.00	0.31
87	000338	潍柴动力	6,200	77,314.00	0.31
88	601169	北京银行	16,900	76,726.00	0.31
89	000100	TCL科技	16,000	76,640.00	0.30
90	300450	先导智能	1,200	75,816.00	0.30
91	600660	福耀玻璃	1,800	75,258.00	0.30
92	601229	上海银行	11,400	74,670.00	0.30
93	601985	中国核电	10,800	74,088.00	0.29
94	600050	中国联通	21,300	73,698.00	0.29
95	601766	中国中车	13,900	72,280.00	0.29
96	601390	中国中铁	11,700	71,838.00	0.29
97	300347	泰格医药	600	68,670.00	0.27
98	601669	中国电建	8,700	68,469.00	0.27
99	600893	航发动力	1,500	68,265.00	0.27
100	600745	闻泰科技	800	68,088.00	0.27
101	603659	璞泰来	800	67,520.00	0.27
102	601658	邮储银行	12,400	66,836.00	0.27
103	000776	广发证券	3,400	63,580.00	0.25
104	600028	中国石化	15,300	62,424.00	0.25
105	600009	上海机场	1,100	62,370.00	0.25

106	600196	复星医药	1,400	61,726.00	0.25
107	600905	三峡能源	9,800	61,642.00	0.25
108	600019	宝钢股份	10,200	61,404.00	0.24
109	600010	包钢股份	26,000	61,100.00	0.24
110	600999	招商证券	4,200	60,522.00	0.24
111	601009	南京银行	5,800	60,436.00	0.24
112	600958	东方证券	5,908	60,320.68	0.24
113	300896	爱美客	100	60,001.00	0.24
114	002410	广联达	1,100	59,884.00	0.24
115	688012	中微公司	509	59,425.75	0.24
116	601628	中国人寿	1,900	59,052.00	0.23
117	601857	中国石油	11,100	58,830.00	0.23
118	000895	双汇发展	2,000	58,600.00	0.23
119	002179	中航光电	920	58,254.40	0.23
120	002821	凯莱英	200	57,800.00	0.23
121	300759	康龙化成	600	57,132.00	0.23
122	601818	光大银行	18,900	56,889.00	0.23
123	600570	恒生电子	1,300	56,602.00	0.23
124	002050	三花智控	2,000	54,960.00	0.22
125	300661	圣邦股份	300	54,606.00	0.22
126	600760	中航沈飞	900	54,405.00	0.22
127	002311	海大集团	900	54,009.00	0.21
128	600346	恒力石化	2,400	53,376.00	0.21
129	600763	通策医疗	300	52,332.00	0.21
130	002493	荣盛石化	3,400	52,326.00	0.21
131	300496	中科创达	400	52,192.00	0.21
132	600460	士兰微	1,000	52,000.00	0.21
133	601633	长城汽车	1,400	51,856.00	0.21
134	688005	容百科技	400	51,776.00	0.21
135	600926	杭州银行	3,400	50,932.00	0.20
136	000538	云南白药	840	50,727.60	0.20

137	002074	国轩高科	1,100	50,160.00	0.20
138	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.20
139	600426	华鲁恒升	1,700	49,640.00	0.20
140	300751	迈为股份	100	49,090.00	0.20
141	000768	中航西飞	1,600	48,464.00	0.19
142	001979	招商蛇口	3,600	48,348.00	0.19
143	601989	中国重工	13,000	48,230.00	0.19
144	300316	晶盛机电	700	47,313.00	0.19
145	600176	中国巨石	2,700	47,007.00	0.19
146	601939	建设银行	7,600	46,056.00	0.18
147	002202	金风科技	3,100	45,880.00	0.18
148	603993	洛阳钼业	8,000	45,840.00	0.18
149	688111	金山办公	231	45,534.72	0.18
150	000963	华东医药	1,000	45,160.00	0.18
151	002920	德赛西威	300	44,400.00	0.18
152	601138	工业富联	4,500	44,280.00	0.18
153	300207	欣旺达	1,400	44,240.00	0.18
154	000166	申万宏源	10,300	44,187.00	0.18
155	601006	大秦铁路	6,700	44,153.00	0.18
156	600132	重庆啤酒	300	43,980.00	0.18
157	601066	中信建投	1,500	43,365.00	0.17
158	600584	长电科技	1,600	43,200.00	0.17
158	300782	卓胜微	320	43,200.00	0.17
160	601377	兴业证券	6,100	43,005.00	0.17
161	601877	正泰电器	1,200	42,936.00	0.17
162	300763	锦浪科技	200	42,600.00	0.17
163	600085	同仁堂	800	42,304.00	0.17
164	601600	中国铝业	8,900	42,275.00	0.17
165	600029	南方航空	5,700	41,667.00	0.17
166	600383	金地集团	3,100	41,664.00	0.17
167	600600	青岛啤酒	400	41,568.00	0.17

168	601838	成都银行	2,500	41,450.00	0.16
169	600741	华域汽车	1,800	41,400.00	0.16
170	600588	用友网络	1,900	41,249.00	0.16
171	601186	中国铁建	5,200	41,080.00	0.16
172	600795	国电电力	10,200	39,882.00	0.16
173	000876	新希望	2,600	39,780.00	0.16
174	601117	中国化学	4,200	39,522.00	0.16
175	600188	兖矿能源	1,000	39,480.00	0.16
176	601111	中国国航	3,400	39,474.00	0.16
177	603806	福斯特	600	39,312.00	0.16
178	300408	三环集团	1,300	39,130.00	0.16
179	603290	斯达半导	100	38,590.00	0.15
180	601238	广汽集团	2,500	38,100.00	0.15
181	000786	北新建材	1,100	38,082.00	0.15
182	600150	中国船舶	2,000	37,960.00	0.15
183	300999	金龙鱼	700	37,814.00	0.15
184	003816	中国广核	13,500	37,800.00	0.15
185	603019	中科曙光	1,300	37,726.00	0.15
186	601800	中国交建	4,000	37,120.00	0.15
186	600547	山东黄金	2,000	37,120.00	0.15
188	601100	恒立液压	600	37,032.00	0.15
189	600989	宝丰能源	2,500	36,625.00	0.15
190	603486	科沃斯	300	36,567.00	0.15
191	600015	华夏银行	7,000	36,470.00	0.15
192	002648	卫星化学	1,400	36,190.00	0.14
193	300601	康泰生物	800	36,144.00	0.14
194	603369	今世缘	700	35,700.00	0.14
194	600886	国投电力	3,400	35,700.00	0.14
196	600011	华能国际	5,000	35,200.00	0.14
197	601868	中国能建	14,800	35,076.00	0.14
198	601788	光大证券	2,200	34,672.00	0.14

199	000157	中联重科	5,600	34,496.00	0.14
200	688008	澜起科技	567	34,348.86	0.14
201	601799	星宇股份	200	34,200.00	0.14
202	600115	中国东航	6,200	34,038.00	0.14
203	000301	东方盛虹	2,000	33,820.00	0.13
204	000425	徐工机械	6,200	33,418.00	0.13
205	002008	大族激光	1,000	33,130.00	0.13
206	002236	大华股份	2,000	32,840.00	0.13
207	002601	龙佰集团	1,600	32,080.00	0.13
208	601916	浙商银行	9,600	31,872.00	0.13
209	002555	三七互娱	1,500	31,845.00	0.13
210	000977	浪潮信息	1,200	31,776.00	0.13
211	002736	国信证券	3,300	31,581.00	0.13
212	601901	方正证券	4,700	31,537.00	0.13
213	688396	华润微	531	31,366.17	0.12
214	603185	上机数控	200	31,198.00	0.12
215	601995	中金公司	700	31,143.00	0.12
216	300454	深信服	300	31,134.00	0.12
217	603392	万泰生物	200	31,060.00	0.12
218	000938	紫光股份	1,600	31,040.00	0.12
219	600352	浙江龙盛	3,000	30,540.00	0.12
220	300628	亿联网络	400	30,460.00	0.12
221	600941	中国移动	500	30,250.00	0.12
222	603833	欧派家居	200	30,136.00	0.12
223	002841	视源股份	400	30,128.00	0.12
224	600219	南山铝业	8,100	29,889.00	0.12
225	000069	华侨城 A	4,600	29,854.00	0.12
226	601336	新华保险	900	28,971.00	0.12
227	688126	沪硅产业	1,255	28,839.90	0.11
228	300595	欧普康视	500	28,595.00	0.11
229	688363	华熙生物	200	28,436.00	0.11

230	601618	中国中冶	8,100	28,350.00	0.11
231	002007	华兰生物	1,200	27,360.00	0.11
232	600845	宝信软件	500	27,300.00	0.11
233	002120	韵达股份	1,600	27,296.00	0.11
234	002252	上海莱士	4,600	27,278.00	0.11
235	601360	三六零	3,200	27,264.00	0.11
236	688036	传音控股	301	26,858.23	0.11
237	300413	芒果超媒	800	26,688.00	0.11
238	000703	恒逸石化	2,500	26,275.00	0.10
239	300003	乐普医疗	1,400	25,998.00	0.10
240	300433	蓝思科技	2,300	25,461.00	0.10
241	300529	健帆生物	500	25,445.00	0.10
242	601155	新城控股	1,000	25,430.00	0.10
243	600332	白云山	800	25,272.00	0.10
244	601878	浙商证券	2,200	25,036.00	0.10
245	300919	中伟股份	200	24,780.00	0.10
246	603882	金域医学	300	24,765.00	0.10
247	002602	世纪华通	5,100	24,582.00	0.10
248	600918	中泰证券	3,200	24,480.00	0.10
249	600489	中金黄金	3,300	24,387.00	0.10
250	002938	鹏鼎控股	800	24,168.00	0.10
251	000066	中国长城	2,200	23,804.00	0.09
252	603260	合盛硅业	200	23,592.00	0.09
253	601021	春秋航空	400	23,340.00	0.09
254	601728	中国电信	6,200	23,126.00	0.09
255	601865	福莱特	600	22,860.00	0.09
256	603899	晨光股份	400	22,432.00	0.09
257	688065	凯赛生物	200	22,360.00	0.09
258	000708	中信特钢	1,100	22,165.00	0.09
259	600183	生益科技	1,300	22,087.00	0.09
260	601898	中煤能源	2,100	21,798.00	0.09

261	300957	贝泰妮	100	21,753.00	0.09
262	600018	上港集团	3,700	21,571.00	0.09
263	600362	江西铜业	1,200	21,396.00	0.09
264	300223	北京君正	200	21,250.00	0.08
265	600161	天坛生物	800	19,424.00	0.08
266	300033	同花顺	200	19,230.00	0.08
267	688561	奇安信	342	19,083.60	0.08
268	002414	高德红外	1,480	19,047.60	0.08
269	002916	深南电路	200	18,742.00	0.07
270	603160	汇顶科技	300	18,579.00	0.07
271	601216	君正集团	3,800	18,544.00	0.07
272	600061	国投资本	2,900	18,444.00	0.07
273	601319	中国人保	3,600	18,216.00	0.07
274	601966	玲珑轮胎	700	17,759.00	0.07
275	600606	绿地控股	4,300	17,028.00	0.07
276	600655	豫园股份	1,800	16,992.00	0.07
277	002568	百润股份	560	16,822.40	0.07
278	601998	中信银行	3,500	16,625.00	0.07
279	000408	藏格矿业	500	16,470.00	0.07
280	002600	领益智造	3,200	16,064.00	0.06
281	603195	公牛集团	100	15,291.00	0.06
282	601881	中国银河	1,500	14,505.00	0.06
283	603087	甘李药业	300	14,391.00	0.06
284	002064	华峰化学	1,700	14,348.00	0.06
285	600025	华能水电	2,000	13,980.00	0.06
286	300866	安克创新	200	13,264.00	0.05
287	002791	坚朗五金	100	12,972.00	0.05
288	002607	中公教育	2,100	12,159.00	0.05
289	002032	苏泊尔	200	11,268.00	0.04
290	000800	一汽解放	1,100	10,274.00	0.04
291	601236	红塔证券	1,100	10,043.00	0.04

292	601808	中海油服	700	9,765.00	0.04
293	000877	天山股份	700	8,610.00	0.03
294	300979	华利集团	100	7,308.00	0.03
295	601825	沪农商行	1,100	6,897.00	0.03
296	601698	中国卫通	500	5,655.00	0.02
297	001289	龙源电力	200	4,352.00	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	601089	福元医药	682	14,356.10	0.06
2	603233	大参林	40	1,252.00	0.00
3	300677	英科医疗	40	1,014.40	0.00
4	601108	财通证券	80	629.60	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	600519	贵州茅台	1,389,950.00	5.53
2	300750	宁德时代	779,206.00	3.10
3	601318	中国平安	611,713.00	2.43
4	600036	招商银行	604,398.00	2.41
5	601012	隆基绿能	381,329.00	1.52
6	000858	五粮液	377,580.00	1.50
7	601166	兴业银行	360,542.00	1.43
8	000333	美的集团	354,926.00	1.41
9	600900	长江电力	331,167.00	1.32
10	300059	东方财富	297,608.00	1.18
11	002594	比亚迪	287,998.00	1.15

12	603259	药明康德	259,702.00	1.03
13	600030	中信证券	244,173.00	0.97
14	300760	迈瑞医疗	244,149.00	0.97
15	600887	伊利股份	239,754.00	0.95
16	601398	工商银行	208,951.00	0.83
17	601888	中国中免	208,881.00	0.83
18	002415	海康威视	208,231.00	0.83
19	000651	格力电器	198,074.00	0.79
20	002475	立讯精密	189,903.00	0.76

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	600519	贵州茅台	184,500.00	0.73
2	300760	迈瑞医疗	94,032.00	0.37
3	300750	宁德时代	83,832.00	0.33
4	601318	中国平安	67,264.00	0.27
5	600036	招商银行	63,540.00	0.25
6	002001	新和成	52,774.20	0.21
7	601012	隆基绿能	41,977.00	0.17
8	601166	兴业银行	37,507.00	0.15
9	000333	美的集团	37,473.00	0.15
10	600900	长江电力	35,390.00	0.14
11	000858	五粮液	35,112.00	0.14
12	002594	比亚迪	35,042.00	0.14
13	300059	东方财富	33,456.00	0.13
14	600436	片仔癀	31,400.00	0.12
15	605499	东鹏饮料	30,802.00	0.12
16	601108	财通证券	30,243.00	0.12

17	603259	药明康德	29,367.00	0.12
18	000783	长江证券	28,574.00	0.11
19	600030	中信证券	26,547.00	0.11
20	600109	国金证券	25,772.00	0.10

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	24,355,545.63
卖出股票收入（成交）总额	3,082,433.66

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

招商银行：2022年3月21日，中国银行保险监督管理委员会对招商银行股份有限公司处以行政处罚。

兴业银行：2022年3月21日，中国银行保险监督管理委员会对兴业银行股份有限公司处以行政处罚。2021年8月13日，中国人民银行对兴业银行股份有限公司处以行政处罚。

2021年7月21日，国家外汇管理局福建省分局对兴业银行股份有限公司处以行政处罚。

本基金为指数型基金，采取完全复制策略，跟踪的标的指数为沪深300指数，以上股票为指数成份股。以上股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除此以外，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	17,931.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,931.84

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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 沪深3 00指 数发 起式A	895	18,587.01	10,000,500.05	60.1 2%	6,634,875.30	39.88%
东财 沪深3 00指 数发 起式C	949	6,141.13	0.00	0.00%	5,827,929.23	100.0 0%
合计	1,76 7	12,712.68	10,000,500.05	44.5 2%	12,462,804.53	55.48%

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	东财沪深300指数 发起式A	-	-
	东财沪深300指数 发起式C	-	-
	合计	-	-

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	东财沪深300指数 发起式A	0
	东财沪深300指数 发起式C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	东财沪深300指数 发起式A	0
	东财沪深300指数 发起式C	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	10,000,500.05	44.52%	10,000,500.05	44.52%	3年
基金管理人高 级管理人员	0.00	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	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

东					
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,500.05	44.52%	10,000,500.05	44.52%	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

	东财沪深300指数发起 式A	东财沪深300指数发起 式C
基金合同生效日(2022年03月15日)基金份额总额	16,949,872.90	7,081,296.48
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	815,796.61	495,381.65
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,130,294.16	1,748,748.90
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	16,635,375.35	5,827,929.23

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，基金托管人资产托管部总经理胡忠孝因工作安排离任，孙英担任国信证券股份有限公司资产托管部副总经理（主持工作）。

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	
国信证券	2	27,424,178.77	100.00%	16,930.82	100.00%	-

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	西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定报纸和网站	2022-03-16
2	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	证监会规定报纸和网站	2022-04-13

	购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告		
3	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	证监会规定报纸和网站	2022-04-30
4	西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	证监会规定报纸和网站	2022-05-21
5	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	证监会规定报纸和网站	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-03-15至2022-06-30	10,000,500.05	-	-	10,000,500.05	44.52%

产品特有风险

本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,存在以下特有风险:(1)持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险;(2)持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的流动性风险;(3)持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险。

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沪深300指数型发起式证券投资基金募集注册的文件

- 二、《西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同》
- 三、《西藏东财沪深300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