# 西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

# 2022年年度报告

2022年12月31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:2023年03月29日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

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

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2023年03月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2022年01月01日起至2022年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 16
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 21
7.3 净资产（基金净值）变动表 23
7.4 报表附注 26
§8 投资组合报告 97
8.1 期末基金资产组合情况 97
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 98
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 100
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 118
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 120
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 120
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 121
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 121
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 121
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 121

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明** ..... 121
**8.12 投资组合报告附注** ..... 121
**§9 基金份额持有人信息** ..... 123
**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构** ..... 123
**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况** ..... 123
**9.3 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** ..... 123
**9.4 发起式基金发起资金持有份额情况** ..... 124
**§10 开放式基金份额变动** ..... 124
**§11 重大事件揭示** ..... 125
**11.1 基金份额持有人大会决议** ..... 125
**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动** ..... 125
**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼** ..... 125
**11.4 基金投资策略的改变** ..... 125
**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况** ..... 125
**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况** ..... 125
**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况** ..... 125
**11.8 其他重大事件** ..... 126
**§12 影响投资者决策的其他重要信息** ..... 128
**12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况** ..... 128
**12.2 影响投资者决策的其他重要信息** ..... 129
**§13 备查文件目录** ..... 129
**13.1 备查文件目录** ..... 129
**13.2 存放地点** ..... 129
**13.3 查阅方式** ..... 129

# §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 | 228,779,991.81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 | 161,533,776.86份 | 67,246,214.95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 | 严格 |
| | 联系电话 | 021-23526999 | 010-65051166 |
| | 电子邮箱 | vip@dongcaijijin.com | AC_Product@cicc.com.cn |
| 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 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.dongcaijijin.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区延安东路222号21楼 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2022年 | | 2021年01月20日（基金合同生效日）-2021年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 东财中证500A | 东财中证500C | 东财中证500A | 东财中证500C |
| 本期已实现收益 | 2,316,743.71 | 644,132.40 | 25,320,783.65 | 11,093,059.46 |
| 本期利润 | -32,211,146.05 | -13,309,911.89 | 38,397,034.13 | 17,010,337.51 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1915 | -0.2052 | 0.1758 | 0.1607 |
| 本期加权平均净值利润率 | -18.50% | -19.94% | 16.53% | 15.21% |
| 本期基金份额净值增长率 | -16.42% | -16.75% | 18.84% | 18.39% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | 2022年末 | | 2021年末 | |
| 期末可供分配利润 | -1,079,856.38 | -968,307.36 | 22,227,472.12 | 8,815,337.61 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0067 | -0.0144 | 0.1293 | 0.1249 |
| 期末基金资产净值 | 160,453,920.48 | 66,277,907.59 | 204,330,103.52 | 83,580,176.88 |
| 期末基金份额净值 | 0.9933 | 0.9856 | 1.1884 | 1.1839 |
| **3.1.3 累计期末指标** | 2022年末 | | 2021年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | -0.67% | -1.44% | 18.84% | 18.39% |

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 3.09% | 0.97% | 2.52% | 0.97% | 0.57% | 0.00% |
| 过去六个月 | -7.06% | 1.04% | -8.66% | 1.04% | 1.60% | 0.00% |
| 过去一年 | -16.42% | 1.30% | -19.30% | 1.31% | 2.88% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.67% | 1.13% | -8.82% | 1.14% | 8.15% | -0.01% |

东财中证500C

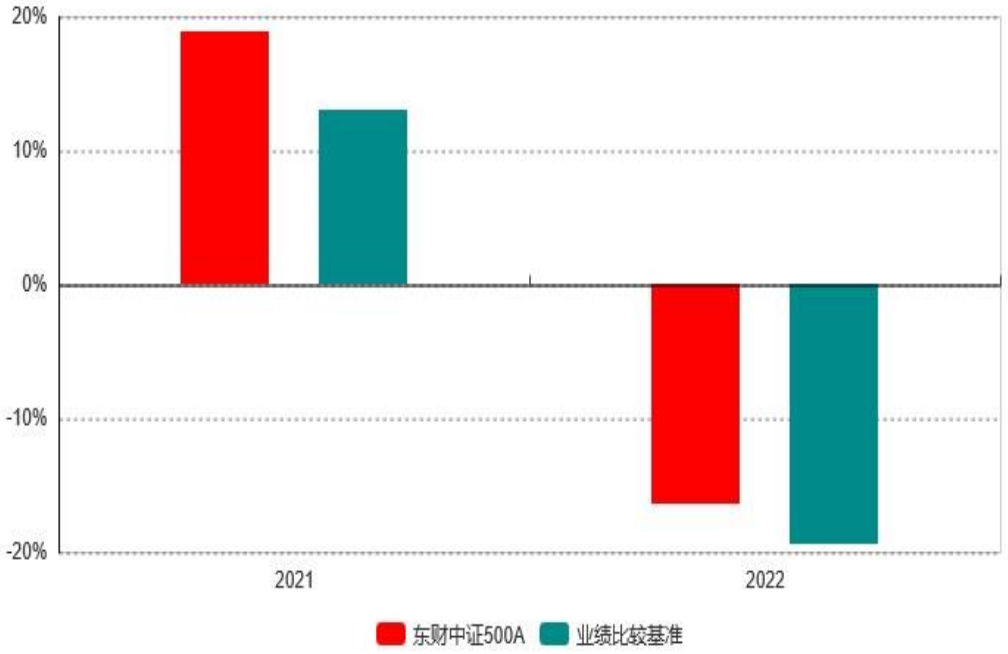
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.99% | 0.97% | 2.52% | 0.97% | 0.47% | 0.00% |
| 过去六个月 | -7.24% | 1.04% | -8.66% | 1.04% | 1.42% | 0.00% |
| 过去一年 | -16.75% | 1.30% | -19.30% | 1.31% | 2.55% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.44% | 1.13% | -8.82% | 1.14% | 7.38% | -0.01% |

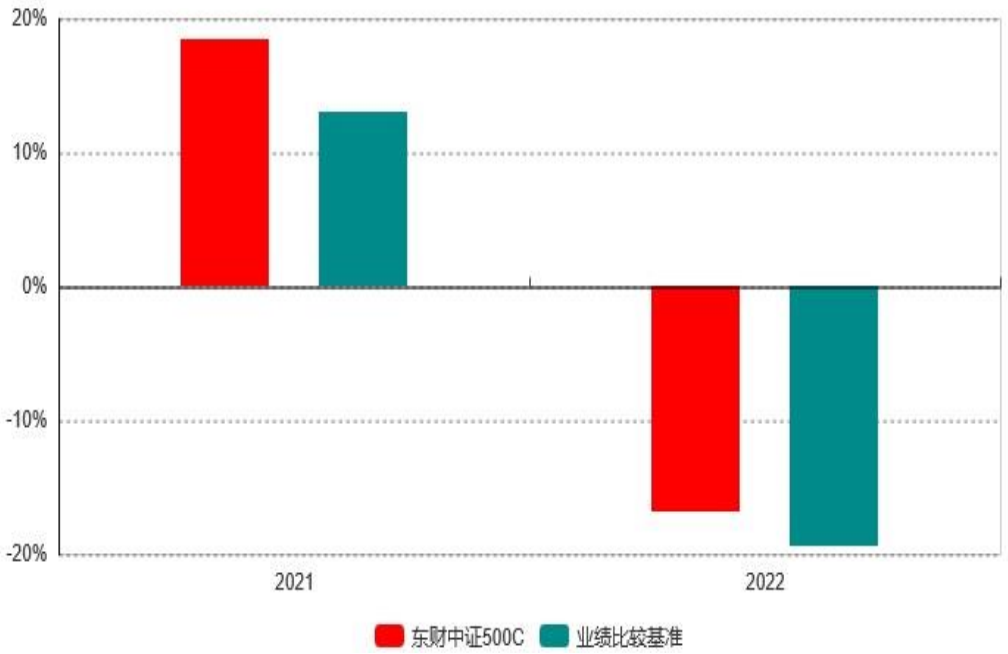
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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。

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




注：本基金基金合同于2021年1月20日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2021年1月20日生效，自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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12月31日，公司旗下管理30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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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、西藏东财品质生活优选混合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)、西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财稳健配置六个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、西藏东财中证证券公司30指数型发起式证券投资基金、西藏东财产业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 | 2021-01-20 | - | 5.5年 | 美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。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、基金经理兼基金经理助理兼研究员等职务。 |
| 莫志刚 | 本基金基金经理助理 | 2022-10-31 | - | 9.5年 | 南京大学计算机技术专业硕士。自2013年4月始，先后在万家基金管理有限公司、南华基金管理有限公司、西藏东财基金管理有限公司担任量化研究员、基金经理兼基金经理助理等职务。 |

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本基金基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及公司内部制度，制定了《公平交易管理制度》。

本基金基金管理人建立科学规范的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露确保公平交易过程和结果的监督。

在投资决策的内部控制方面，研究员根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围等，建立不同投资组合的投资对象备选库，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。交易执行中，交易员执行投资交易系统中的公平交易程序，并严格按照价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的原则执行交易指令，确保交易执行的公平性。

行为监控方面，建立了有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，并建立相关记录制度，确保公平交易可稽核；对交易价格的公允性进行审查，相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）对不同投资组合的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控和分析。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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12月31日，东财中证500A份额净值为0.9933元，报告期内基金份额净值增长率为-16.42%，东财中证500C份额净值为0.9856元，报告期内基金份额净值增长率为-16.75%，同期业绩比较基准收益率为-19.30%。

## 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，在内外部的多重风险挑战下，中国宏观经济面临需求收缩、供给冲击和预期转弱的局面，宏观经济修复一波三折、整体偏弱，GDP增速不及年初预期目标。具体来看，中国经济呈现出口韧性强、消费需求弱、宏观政策护航的特点：消费受疫情冲击影响显著，但在年底防控政策调整后复苏可期；固定资产投资在基础设施建设投资拉动下增长较为平稳，然而房地产投资额的持续下降拖累整体投资，随着房地产纾困政策持续落地，房地产市场信心和活力有望恢复。展望2023年，通胀压力、加息周期、地缘政治冲突等因素仍将是全球经济的重要决定因素；国内来看，疫情防控政策松绑将加速经济活力释放，叠加存量政策和增量政策发力，消费、生产、投资、就业均有望得以明显改善，此外基数效应也将对2023年经济数据形成支撑。

从资本市场来看，2022年我国经济面临多重压力的背景下，A股市场呈现震荡回调格局，整体表现偏弱。上证指数和深圳成指经历了2019-2021年年线3连阳后再度进入调整。与全球主要股指表现比较来看，A股市场主要指数的跌幅排名靠前。展望2023年，受益于经济复苏、流动性宽松、企业盈利改善等因素，股票市场或迎来估值业绩双重修复，配置价值有望得以提升。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金基金管理人坚持投资者利益至上、坚持违法违规零容忍、严防触犯三条底线作为公司的最高经营宗旨和全体员工的根本行为准则，为全面风险管理、全程风险管理与全员风险管理相关内部控制管理规范的推行提供相对有利的内部控制环境；同时依据不断发展变化的外部经营环境、监管环境与业务实践对于公司内部控制与风险管理持续进行动态的调整与修正。本基金基金管理人根据法律法规、监管政策的变化和业务发展情况，从合规运作、维护基金份额持有人利益的角度出发，持续完善内部控制制度和流程，加强内部风险的控制与防范，确保内控体系和各项制度措施的落实，有效保障了公司各项业务合法合规的有序开展。

报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：一是执行监察稽核信息动态通报与执行跟进机制，及时进行内部传达以及组织员工学习理解；二是通过相关内部以及外部合规风控培训、日常投资申报管理、员工行为规范管理等方式不断强化员工的合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突；三是协调内部管理制度体系的修订和完善，推动公司各业务部门持续完善各项管理制度和业务流程建设，防范日常运作中发生违法违规行为与风险事件；四是执行基金运作过程中的临时公告、定期报告、招募说明书更新等相关信息披露工作；五是采取事前、事中和事后三阶段的防范控制工作，从投资决策、研究支持、交易执行、投资监督与风险管理、关联交易管理、公平交易与异常交易监控、内幕交易防控等各方面持续加强对于投资管理业务的内部控制，保障基金投资运作合法合规；六是对基金运作过程中的营销与销售、会计核算估值、信息技术支持等方面进行内部控制与合规管理；七是通过独立开展定期或不定期内部审计，监督检查各业务条线相关内部控制措施设计的合理性以及执行的有效性，针对发现的问题相应提出改进建议并督促相关业务部门及时落实改进措施；八是重视反洗钱各项工作，包括制度建设、系统功能优化、宣传培训、日常监测等方面，积极采取有效的防范措施控制洗钱的风险。

报告期内，本基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。本基金基金管理人将继续坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金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。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未发生相关预警情形。

## §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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《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重大违规行为。

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

本报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

| | |
|---|---|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 德师报（审）字（23）第P00272号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

| | |
|---|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金全体持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 强调事项 | 无 |
| 其他事项 | 无 |
| 其他信息 | 西藏东财基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其 |

| | |
|---|---|
| | 他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 基金管理人管理层负责按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险；（2）了解与审计相关的内部控制，以设计 |

| | |
|---|---|
| | 恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见；（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性；（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金不能持续经营；（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |
| 会计师事务所的名称 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 吴凌志、孔维婷 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区延安东路222号21楼 |
| 审计报告日期 | 2023-03-29 |

## §7 年度财务报表

### 7.1 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12月31日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---|---|---|---|

| **资 产：** | | | |
|---|---|---|---|
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 12,681,656.06 | 15,478,533.78 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 214,549,149.48 | 273,513,444.68 |
| 其中：股票投资 | | 214,549,149.48 | 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 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 | | 33,847.77 | 53,988.64 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.5 | 5,767.69 | 2,867.18 |
| 资产总计 | | 227,270,421.00 | 289,048,834.28 |
| **负债和净资产** | **附注号** | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 144,253.67 | 825,755.51 |
| 应付管理人报酬 | | 96,640.27 | 122,626.06 |
| 应付托管费 | | 9,664.04 | 12,262.60 |
| 应付销售服务费 | | 21,263.10 | 28,502.29 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,359.01 | 455.61 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.6 | 265,412.84 | 148,951.81 |
| 负债合计 | | 538,592.93 | 1,138,553.88 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.7 | 228,779,991.81 | 242,537,370.03 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.8 | -2,048,163.74 | 45,372,910.37 |
| 净资产合计 | | 226,731,828.07 | 287,910,280.40 |
| 负债和净资产总计 | | 227,270,421.00 | 289,048,834.28 |

注：报告截止日2022年12月31日，东财中证500A基金份额净值人民币0.9933元，基金份额总额161,533,776.86份；东财中证500C基金份额净值人民币0.9856元，基金份额总额67,246,214.95份。基金份额总额合计为228,779,991.81份。

**7.2 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12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|---|

| | | | |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | -43,731,968.23 | 58,818,867.88 |
| 1.利息收入 | | 351,622.64 | 369,645.50 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.9 | 69,549.19 | 149,602.91 |
| 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 | | 282,073.45 | 220,042.59 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 4,369,346.18 | 39,410,126.54 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.10 | 369,425.15 | 34,946,682.57 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.11 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 3,999,921.03 | 4,463,443.97 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -48,481,934.05 | 18,993,528.53 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 28,997.00 | 45,567.31 |
| **减：二、营业总支出** | | 1,789,089.71 | 3,411,496.24 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 1,204,609.88 | 1,631,497.55 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 120,460.98 | 163,149.77 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3．销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 267,232.25 | 424,985.94 |
| 4．投资顾问费 | | - | - |
| 5．利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6．信用减值损失 | 7.4.7.18 | - | - |
| 7．税金及附加 | | 1,016.04 | 792.59 |
| 8．其他费用 | 7.4.7.19 | 195,770.56 | 1,191,070.39 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | -45,521,057.94 | 55,407,371.64 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | -45,521,057.94 | 55,407,371.64 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | -45,521,057.94 | 55,407,371.64 |

**7.3 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12月31日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31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） | -13,757,378.22 | - | -47,421,074.11 | -61,178,452.33 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -45,521,057.94 | -45,521,057.94 |
| （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） | -13,757,378.22 | - | -1,900,016.17 | -15,657,394.39 |
| 其中：1.基金申购款 | 96,690,099.32 | - | 3,335,432.57 | 100,025,531.89 |
| 2.基金赎回款 | -110,447,477.54 | - | -5,235,448.74 | -115,682,926.28 |
| （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） | 228,779,991.81 | - | -2,048,163.74 | 226,731,828.07 |

| 项 目 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31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） | | | | |
| 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） | -162,682,480.28 | - | 45,372,910.37 | -117,309,569.91 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 55,407,371.64 | 55,407,371.64 |
| （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） | -162,682,480.28 | - | -10,034,461.27 | -172,716,941.55 |
| 其中：1.基金申购款 | 182,116,640.73 | - | 16,911,182.68 | 199,027,823.41 |
| 2.基金赎回款 | -344,799,121.01 | - | -26,945,643.95 | -371,744,764.96 |
| （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） | 242,537,370.03 | - | 45,372,910.37 | 287,910,280.40 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

| | | |
|---|---|---|
| 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 |

**7.4 报表附注**

**7.4.1 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%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。上年度可比期间为2021年1月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

根据本基金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，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

（2）金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

**7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

本基金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。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，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的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用

风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

**7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

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基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。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原则如下：

（1）对存在活跃市场的投资品种，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。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当投资品种不存在活跃市场，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。

（3）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，对估值进行调整，确定公允价值。

**7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

**7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

**7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

**7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量**

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

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。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除权（息）日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

（3）公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

（5）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。

**7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提。

**7.4.4.11 基金的收益分配政策**

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的该类别基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

（4）由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

**7.4.4.12 外币交易**

本基金本报告期无外币交易。

**7.4.4.13 分部报告**

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）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）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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

**7.4.4.14 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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《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》（以下简称“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》（财会[2020]22号），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新金融工具准则，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。

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0.00元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金及应收利息，金额分别为人民币15,478,533.78元、人民币0.00元及人民币2,867.18元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金及其他资产-应收利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金及其他资产-应收利息等项目中，不单独列示应收利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金及其他资产-应收利息，金额分别为人民币15,481,400.96元、人民币0.00元及人民币0.00元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币273,513,444.68元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币0.00元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币273,513,444.68元。

本基金自2022年7月1日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号），并按相关衔接规定进行了处理。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）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、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

（2）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，暂不缴纳企业所得税。

（3）对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

（4）对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 5,582,853.69 | 6,548,795.04 |
| 等于：本金 | 5,581,568.38 | 6,548,795.04 |
| 加：应计利息 | 1,285.31 | - |
| 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 | 7,098,802.37 | 8,929,738.74 |
| 等于：本金 | 7,097,810.85 | 8,929,738.74 |
| 加：应计利息 | 991.52 | - |
| 合计 | 12,681,656.06 | 15,478,533.78 |

**7.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2022年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 244,037,555.00 | - | 214,549,149.48 | -29,488,405.52 |
| 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 | | 244,037,555.00 | - | 214,549,149.48 | -29,488,405.52 |
| 项目 | | 上年度末<br>2021年12月31日 | | | |
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 254,519,916.15 | - | 273,513,444.68 | 18,993,528.53 |
| 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 | | 254,519,916.15 | - | 273,513,444.68 | 18,993,528.53 |

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债余额。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产余额。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 其他资产**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| 应收利息 | - | 2,867.18 |
| 其他应收款 | 5,767.69 | - |
| 待摊费用 | - | - |
| 合计 | 5,767.69 | 2,867.18 |

**7.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 3.40 | 47.93 |
| 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 | 24,000.00 | 24,000.00 |
| 预提费用-信息披露费 | 230,000.00 | 110,000.00 |
| 其他应付 | 11,409.44 | 14,903.88 |
| 合计 | 265,412.84 | 148,951.81 |

**7.4.7.7 实收基金**

**7.4.7.7.1 东财中证500A**

金额单位：人民币元

| 项目<br>(东财中证500A) | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 171,939,440.28 | 171,939,440.28 |
| 本期申购 | 59,896,104.57 | 59,896,104.57 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -70,301,767.99 | -70,301,767.99 |
| 本期末 | 161,533,776.86 | 161,533,776.86 |

**7.4.7.7.2 东财中证500C**

金额单位：人民币元

| 项目<br>(东财中证500C) | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 70,597,929.75 | 70,597,929.75 |
| 本期申购 | 36,793,994.75 | 36,793,994.75 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -40,145,709.55 | -40,145,709.55 |
| 本期末 | 67,246,214.95 | 67,246,214.95 |

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。

**7.4.7.8 未分配利润**

**7.4.7.8.1 东财中证500A**

单位：人民币元

| 项目<br>(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 | 2,316,743.71 | -34,527,889.76 | -32,211,146.05 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,422,877.63 | 163,504.06 | -1,259,373.57 |
| 其中：基金申购款 | 8,117,163.33 | -5,736,271.73 | 2,380,891.60 |
| 基金赎回款 | -9,540,040.96 | 5,899,775.79 | -3,640,265.17 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 23,121,338.20 | -24,201,194.58 | -1,079,856.38 |

**7.4.7.8.2 东财中证500C**

单位：人民币元

| 项目<br>(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 | 644,132.40 | -13,954,044.29 | -13,309,911.89 |
| 本期基金份额交易产 | -412,551.57 | -228,091.03 | -640,642.60 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 4,808,336.16 | -3,853,795.19 | 954,540.97 |
| 基金赎回款 | -5,220,887.73 | 3,625,704.16 | -1,595,183.57 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 9,046,918.44 | -10,015,225.80 | -968,307.36 |

**7.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至<br>2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 45,260.18 | 83,941.34 |
| 定期存款利息收入 | - | - |
| 其他存款利息收入 | 24,289.01 | 65,661.57 |
| 结算备付金利息收入 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 69,549.19 | 149,602.91 |

**7.4.7.10 股票投资收益**

**7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至<br>2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 130,739,921.21 | 322,593,164.23 |
| 减：卖出股票成本总额 | 129,951,883.91 | 287,646,481.66 |
| 减：交易费用 | 418,612.15 | - |
| 买卖股票差价收入 | 369,425.15 | 34,946,682.57 |

**7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无证券出借差价收入。

**7.4.7.11 债券投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

**7.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至<br>2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 3,999,921.03 | 4,463,443.97 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | 135,296.28 | 68,205.85 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 3,999,921.03 | 4,463,443.97 |

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -48,481,934.05 | 18,993,528.53 |
| ——股票投资 | -48,481,934.05 | 18,993,528.53 |
| ——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 | -48,481,934.05 | 18,993,528.53 |

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 13,804.60 | 43,753.63 |
| 转换费收入 | 15,192.40 | 1,813.68 |
| 合计 | 28,997.00 | 45,567.31 |

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。

**7.4.7.18 信用减值损失**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生信用减值损失。

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 24,000.00 | 24,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 110,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 汇划手续费 | 3,586.16 | 7,051.18 |
| 指数使用费 | 48,184.40 | 65,259.89 |
| 开户费 | - | 400.00 |

| | | |
|---|---|---|
| 交易费用 | - | 984,359.32 |
| 合计 | 195,770.56 | 1,191,070.39 |

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

**7.4.9 关联方关系**

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 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：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；下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额 | 成交金额 | 占当期股票成交总额 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 的比例 | | 的比例 |
| 东财证券 | 230,852,162.88 | 100.00% | 849,670,074.96 | 100.00% |

**7.4.10.1.2 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。

**7.4.10.1.3 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。

**7.4.10.1.4 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。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 东财证券 | 223,976.66 | 100.00% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 东财证券 | 556,079.72 | 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。

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,204,609.88 | 1,631,497.55 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 571,752.11 | 786,384.37 |

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×0.50%÷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

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 120,460.98 | 163,149.77 |

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×0.05%÷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

**7.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 东财中证500A | 东财中证500C | 合计 |
| 西藏东财基金管理 | 0.00 | 716.51 | 716.51 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 有限公司 | | | |
| 天天基金 | 0.00 | 207,015.71 | 207,015.71 |
| 东财证券 | 0.00 | 53,413.69 | 53,413.69 |
| 合计 | 0.00 | 261,145.91 | 261,145.91 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31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 |
| 西藏东财基金管理有限公司 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 天天基金 | 0.00 | 329,408.93 | 329,408.93 |
| 东财证券 | 0.00 | 88,568.20 | 88,568.20 |
| 合计 | - | 417,977.13 | 417,977.13 |

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×0.40%÷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

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

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。

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

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

单位：人民币元

| 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 交易金额 | 利息收入 | 期末证券出借业务余额 | 期末应收利息余额 |
| 东财证券 | 5,453,118.00 | 3,844.43 | - | - |

| 上年度可比期间<br>2021年01月20日至2021年12月31日 | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 交易金额 | 利息收入 | 期末证券出借业务余额 | 期末应收利息余额 |
| 东财证券 | 361,780,999.00 | 169,505.09 | - | - |

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

单位：人民币元

| 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 合约编号 | 证券名称 | 成交时间 | 交易金额 | 交易数量（股） | 出借期限（天） | 费率 | 利息收入 | 期末证券出借业务余额 | 期末应收利息余额 |
| 东财证券 | 20221121000008096 | 昆仑万维 | 2022-11-21 | 111,675.00 | 7,500 | 14 | 3.60% | 156.35 | - | - |
| 上年度可比期间<br>2021年01月20日至2021年12月31日 | | | | | | | | | | |
| 关联方名称 | 合约编号 | 证券名称 | 成交时间 | 交易金额 | 交易数量（股） | 出借期限（天） | 费率 | 利息收入 | 期末证券出借业务余额 | 期末应收利息余额 |
| 东财证券 | 20210729000005019 | 我武生物 | 2021-07-29 | 352,830.00 | 5,700 | 7.00 | 3.40% | 233.26 | - | - |
| 东财证券 | 20210729000005021 | 寒锐钴业 | 2021-07-29 | 432,576.00 | 4,800 | 7.00 | 3.40% | 285.98 | - | - |
| 东财证券 | 20210729000005023 | 景嘉微 | 2021-07-29 | 300,564.00 | 3,300 | 7.00 | 3.40% | 198.71 | - | - |
| 东财证券 | 20210729000005025 | 普利制药 | 2021-07-29 | 262,392.00 | 5,800 | 7.00 | 3.40% | 173.47 | - | - |
| 东财证 | 2021072 | 顺网科 | 2021-07 | 157,62 | 10,600 | 7.00 | 3.40% | 104.21 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 900000526 | 技 | -29 | 2.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 202107290000052 9 | 华宇软件 | 2021-07-29 | 323,990.00 | 18,100 | 7.00 | 3.40% | 214.19 | - | - |
| 东财证券 | 202107290000053 1 | 开山股份 | 2021-07-29 | 123,018.00 | 8,700 | 7.00 | 3.40% | 81.33 | - | - |
| 东财证券 | 202107290000053 3 | 掌趣科技 | 2021-07-29 | 235,200.00 | 60,000 | 7.00 | 3.40% | 155.49 | - | - |
| 东财证券 | 202107290000053 5 | 捷成股份 | 2021-07-29 | 182,754.00 | 42,600 | 7.00 | 3.40% | 120.82 | - | - |
| 东财证券 | 202107290000053 7 | 三聚环保 | 2021-07-29 | 180,516.00 | 30,700 | 7.00 | 3.40% | 119.34 | - | - |
| 东财证券 | 202107290000053 9 | 卫宁健康 | 2021-07-29 | 552,048.00 | 37,100 | 7.00 | 3.40% | 364.97 | - | - |
| 东财证券 | 202107290000054 1 | 利亚德 | 2021-07-29 | 424,394.00 | 44,300 | 7.00 | 3.40% | 280.57 | - | - |
| 东财证券 | 202107290000068 5 | 国瓷材料 | 2021-07-29 | 852,775.00 | 17,500 | 7.00 | 3.40% | 563.78 | - | - |
| 东财证券 | 202107230000053 6 | 北京君正 | 2021-07-23 | 410,956.00 | 2,800 | 14.00 | 2.70% | 431.50 | - | - |
| 东财证券 | 202108050000904 7 | 卫宁健康 | 2021-08-05 | 534,240.00 | 37,100 | 7.00 | 3.40% | 353.19 | - | - |
| 东财证券 | 202108050000904 9 | 掌趣科技 | 2021-08-05 | 214,200.00 | 60,000 | 7.00 | 3.40% | 141.61 | - | - |
| 东财证券 | 202108050000905 1 | 开山股份 | 2021-08-05 | 133,980.00 | 8,700 | 7.00 | 3.40% | 88.58 | - | - |
| 东财证券 | 202108050000905 3 | 三聚环保 | 2021-08-05 | 174,069.00 | 30,700 | 7.00 | 3.40% | 115.08 | - | - |
| 东财证券 | 202108050000905 5 | 捷成股份 | 2021-08-05 | 167,844.00 | 42,600 | 7.00 | 3.40% | 110.96 | - | - |
| 东财证券 | 202108050001015 7 | 国瓷材料 | 2021-08-05 | 895,125.00 | 17,500 | 7.00 | 3.40% | 591.78 | - | - |
| 东财证券 | 202108050001015 9 | 景嘉微 | 2021-08-05 | 344,190.00 | 3,300 | 7.00 | 3.40% | 227.55 | - | - |
| 东财证券 | 202108050001016 1 | 我武生物 | 2021-08-05 | 357,105.00 | 5,700 | 7.00 | 3.40% | 236.09 | - | - |
| 东财证 | 202108 | 普利制 | 2021-08 | 272,71 | 5,800 | 7.00 | 3.40% | 180.30 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 500010163 | 药 | -05 | 6.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 2021080500010165 | 顺网科技 | 2021-08-05 | 129,744.00 | 10,600 | 7.00 | 3.40% | 85.78 | - | - |
| 东财证券 | 2021080500010167 | 利亚德 | 2021-08-05 | 436,798.00 | 44,300 | 7.00 | 3.40% | 288.77 | - | - |
| 东财证券 | 2021080500010169 | 寒锐钴业 | 2021-08-05 | 421,440.00 | 4,800 | 7.00 | 3.40% | 278.62 | - | - |
| 东财证券 | 2021080500010171 | 华宇软件 | 2021-08-05 | 314,397.00 | 18,100 | 7.00 | 3.40% | 207.85 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017003 | 景嘉微 | 2021-08-12 | 319,176.00 | 3,300 | 7.00 | 3.40% | 211.01 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017005 | 我武生物 | 2021-08-12 | 346,275.00 | 5,700 | 7.00 | 3.40% | 228.93 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017007 | 普利制药 | 2021-08-12 | 267,206.00 | 5,800 | 7.00 | 3.40% | 176.65 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017009 | 顺网科技 | 2021-08-12 | 124,868.00 | 10,600 | 7.00 | 3.40% | 82.55 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017011 | 利亚德 | 2021-08-12 | 428,381.00 | 44,300 | 7.00 | 3.40% | 283.21 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017013 | 寒锐钴业 | 2021-08-12 | 422,256.00 | 4,800 | 7.00 | 3.40% | 279.16 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017015 | 华宇软件 | 2021-08-12 | 330,687.00 | 18,100 | 7.00 | 3.40% | 218.62 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017051 | 卫宁健康 | 2021-08-12 | 518,287.00 | 37,100 | 7.00 | 3.40% | 342.65 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017053 | 掌趣科技 | 2021-08-12 | 218,400.00 | 60,000 | 7.00 | 3.40% | 144.39 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017055 | 开山股份 | 2021-08-12 | 130,152.00 | 8,700 | 7.00 | 3.40% | 86.04 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017057 | 三聚环保 | 2021-08-12 | 178,367.00 | 30,700 | 7.00 | 3.40% | 117.92 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017059 | 捷成股份 | 2021-08-12 | 196,386.00 | 42,600 | 7.00 | 3.40% | 129.83 | - | - |
| 东财证券 | 2021081200017061 | 国瓷材料 | 2021-08-12 | 818,475.00 | 17,500 | 7.00 | 3.40% | 541.10 | - | - |
| 东财证 | 2021080 | 北京君 | 2021-08 | 452,14 | 2,800 | 14.00 | 2.70% | 474.75 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 600007732 | 正 | -06 | 4.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 2021081000000345 | 易华录 | 2021-08-10 | 217,248.00 | 6,200 | 14.00 | 3.20% | 270.35 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009287 | 景嘉微 | 2021-08-19 | 303,138.00 | 3,300 | 7.00 | 3.40% | 200.41 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009289 | 我武生物 | 2021-08-19 | 335,958.00 | 5,700 | 7.00 | 3.40% | 222.11 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009291 | 普利制药 | 2021-08-19 | 260,014.00 | 5,800 | 7.00 | 3.40% | 171.90 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009293 | 顺网科技 | 2021-08-19 | 115,858.00 | 10,600 | 7.00 | 3.40% | 76.60 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009295 | 利亚德 | 2021-08-19 | 386,296.00 | 44,300 | 7.00 | 3.40% | 255.38 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009297 | 寒锐钴业 | 2021-08-19 | 434,928.00 | 4,800 | 7.00 | 3.40% | 287.54 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009299 | 华宇软件 | 2021-08-19 | 314,759.00 | 18,100 | 7.00 | 3.40% | 208.09 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009301 | 卫宁健康 | 2021-08-19 | 507,157.00 | 37,100 | 7.00 | 3.40% | 335.29 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009303 | 掌趣科技 | 2021-08-19 | 213,000.00 | 60,000 | 7.00 | 3.40% | 140.82 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009305 | 开山股份 | 2021-08-19 | 120,756.00 | 8,700 | 7.00 | 3.40% | 79.83 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009307 | 三聚环保 | 2021-08-19 | 190,340.00 | 30,700 | 7.00 | 3.40% | 125.84 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009309 | 捷成股份 | 2021-08-19 | 205,332.00 | 42,600 | 7.00 | 3.40% | 135.75 | - | - |
| 东财证券 | 2021081900009311 | 国瓷材料 | 2021-08-19 | 803,775.00 | 17,500 | 7.00 | 3.40% | 531.38 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014097 | 顺网科技 | 2021-08-26 | 109,498.00 | 10,600 | 7.00 | 3.40% | 72.39 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014099 | 利亚德 | 2021-08-26 | 443,443.00 | 44,300 | 7.00 | 3.40% | 293.17 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014101 | 寒锐钴业 | 2021-08-26 | 449,616.00 | 4,800 | 7.00 | 3.40% | 297.25 | - | - |
| 东财证 | 2021082 | 景嘉微 | 2021-08 | 400,71 | 3,300 | 7.00 | 3.40% | 264.92 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 600014103 | | -26 | 9.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 2021082600014105 | 我武生物 | 2021-08-26 | 308,826.00 | 5,700 | 7.00 | 3.40% | 204.17 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014107 | 普利制药 | 2021-08-26 | 240,062.00 | 5,800 | 7.00 | 3.40% | 158.71 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014109 | 华宇软件 | 2021-08-26 | 316,750.00 | 18,100 | 7.00 | 3.40% | 209.41 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014111 | 三聚环保 | 2021-08-26 | 194,638.00 | 30,700 | 7.00 | 3.40% | 128.68 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014113 | 捷成股份 | 2021-08-26 | 208,740.00 | 42,600 | 7.00 | 3.40% | 138.00 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014115 | 国瓷材料 | 2021-08-26 | 807,625.00 | 17,500 | 7.00 | 3.40% | 533.93 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014117 | 卫宁健康 | 2021-08-26 | 518,287.00 | 37,100 | 7.00 | 3.40% | 342.65 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014119 | 掌趣科技 | 2021-08-26 | 219,000.00 | 60,000 | 7.00 | 3.40% | 144.78 | - | - |
| 东财证券 | 2021082600014121 | 开山股份 | 2021-08-26 | 133,980.00 | 8,700 | 7.00 | 3.40% | 88.58 | - | - |
| 东财证券 | 2021082000008376 | 北京君正 | 2021-08-20 | 434,812.00 | 2,800 | 14.00 | 2.70% | 456.55 | - | - |
| 东财证券 | 2021082400018077 | 易华录 | 2021-08-24 | 186,000.00 | 6,200 | 14.00 | 3.20% | 231.47 | - | - |
| 东财证券 | 2021090200012126 | 顺网科技 | 2021-09-02 | 114,162.00 | 10,600 | 7.00 | 3.40% | 75.47 | - | - |
| 东财证券 | 2021090200012128 | 利亚德 | 2021-09-02 | 436,798.00 | 44,300 | 7.00 | 3.40% | 288.77 | - | - |
| 东财证券 | 2021090200012130 | 寒锐钴业 | 2021-09-02 | 426,624.00 | 4,800 | 7.00 | 3.40% | 282.05 | - | - |
| 东财证券 | 2021090200012132 | 景嘉微 | 2021-09-02 | 369,072.00 | 3,300 | 7.00 | 3.40% | 244.00 | - | - |
| 东财证券 | 2021090200012134 | 我武生物 | 2021-09-02 | 282,264.00 | 5,700 | 7.00 | 3.40% | 186.61 | - | - |
| 东财证券 | 2021090200012136 | 普利制药 | 2021-09-02 | 230,202.00 | 5,800 | 7.00 | 3.40% | 152.19 | - | - |
| 东财证 | 2021090 | 华宇软 | 2021-09 | 201,45 | 18,100 | 7.00 | 3.40% | 133.18 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 2000121<br>38 | 件 | -02 | 3.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 2021090<br>2000121<br>40 | 三聚环保 | 2021-09<br>-02 | 203,84<br>8.00 | 30,700 | 7.00 | 3.40% | 134.77 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>2000121<br>42 | 捷成股份 | 2021-09<br>-02 | 213,42<br>6.00 | 42,600 | 7.00 | 3.40% | 141.10 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>2000121<br>44 | 国瓷材料 | 2021-09<br>-02 | 777,35<br>0.00 | 17,500 | 7.00 | 3.40% | 513.91 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>2000121<br>46 | 卫宁健康 | 2021-09<br>-02 | 533,49<br>8.00 | 37,100 | 7.00 | 3.40% | 352.70 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>2000121<br>48 | 掌趣科技 | 2021-09<br>-02 | 222,00<br>0.00 | 60,000 | 7.00 | 3.40% | 146.77 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>2000121<br>50 | 开山股份 | 2021-09<br>-02 | 130,41<br>3.00 | 8,700 | 7.00 | 3.40% | 86.22 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>57 | 顺网科技 | 2021-09<br>-09 | 141,72<br>2.00 | 10,600 | 7.00 | 3.40% | 93.69 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>59 | 利亚德 | 2021-09<br>-09 | 448,31<br>6.00 | 44,300 | 7.00 | 3.40% | 296.39 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>61 | 寒锐钴业 | 2021-09<br>-09 | 413,76<br>0.00 | 4,800 | 7.00 | 3.40% | 273.54 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>63 | 景嘉微 | 2021-09<br>-09 | 368,77<br>5.00 | 3,300 | 7.00 | 3.40% | 243.80 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>65 | 我武生物 | 2021-09<br>-09 | 298,16<br>7.00 | 5,700 | 7.00 | 3.40% | 197.12 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>67 | 普利制药 | 2021-09<br>-09 | 228,75<br>2.00 | 5,800 | 7.00 | 3.40% | 151.23 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>69 | 华宇软件 | 2021-09<br>-09 | 208,51<br>2.00 | 18,100 | 7.00 | 3.40% | 137.85 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>71 | 三聚环保 | 2021-09<br>-09 | 212,75<br>1.00 | 30,700 | 7.00 | 3.40% | 140.65 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>73 | 捷成股份 | 2021-09<br>-09 | 213,00<br>0.00 | 42,600 | 7.00 | 3.40% | 140.82 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>75 | 国瓷材料 | 2021-09<br>-09 | 741,30<br>0.00 | 17,500 | 7.00 | 3.40% | 490.08 | - | - |
| 东财证券 | 2021090<br>9000156<br>77 | 卫宁健康 | 2021-09<br>-09 | 541,66<br>0.00 | 37,100 | 7.00 | 3.40% | 358.10 | - | - |
| 东财证 | 2021090 | 掌趣科 | 2021-09 | 247,80 | 60,000 | 7.00 | 3.40% | 163.82 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 900015679 | 技 | -09 | 0.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 20210909000156581 | 开山股份 | 2021-09-09 | 137,460.00 | 8,700 | 7.00 | 3.40% | 90.88 | - | - |
| 东财证券 | 20210903000089663 | 北京君正 | 2021-09-03 | 390,544.00 | 2,800 | 14.00 | 2.70% | 410.07 | - | - |
| 东财证券 | 20210907000213771 | 易华录 | 2021-09-07 | 207,700.00 | 6,200 | 14.00 | 3.20% | 276.93 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000140007 | 顺网科技 | 2021-09-16 | 146,704.00 | 10,600 | 7.00 | 3.40% | 96.99 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000140009 | 利亚德 | 2021-09-16 | 445,658.00 | 44,300 | 7.00 | 3.40% | 294.63 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000140011 | 寒锐钴业 | 2021-09-16 | 404,160.00 | 4,800 | 7.00 | 3.40% | 267.19 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000140013 | 景嘉微 | 2021-09-16 | 448,503.00 | 3,300 | 7.00 | 3.40% | 296.51 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000143061 | 我武生物 | 2021-09-16 | 284,202.00 | 5,700 | 7.00 | 3.40% | 187.89 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000143063 | 普利制药 | 2021-09-16 | 247,196.00 | 5,800 | 7.00 | 3.40% | 163.42 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000143065 | 华宇软件 | 2021-09-16 | 221,363.00 | 18,100 | 7.00 | 3.40% | 146.35 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000143067 | 三聚环保 | 2021-09-16 | 222,575.00 | 30,700 | 7.00 | 3.40% | 147.15 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000143069 | 捷成股份 | 2021-09-16 | 207,888.00 | 42,600 | 7.00 | 3.40% | 137.44 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000143071 | 国瓷材料 | 2021-09-16 | 712,425.00 | 17,500 | 7.00 | 3.40% | 470.99 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000143073 | 卫宁健康 | 2021-09-16 | 507,899.00 | 37,100 | 7.00 | 3.40% | 335.78 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000143075 | 掌趣科技 | 2021-09-16 | 245,400.00 | 60,000 | 7.00 | 3.40% | 162.24 | - | - |
| 东财证券 | 20210916000143077 | 开山股份 | 2021-09-16 | 143,637.00 | 8,700 | 7.00 | 3.40% | 94.96 | - | - |
| 东财证券 | 20210923000167691 | 顺网科技 | 2021-09-23 | 138,118.00 | 10,600 | 7.00 | 3.40% | 91.31 | - | - |
| 东财证 | 2021092 | 利亚德 | 2021-09 | 446,10 | 44,300 | 7.00 | 3.40% | 294.92 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 300016793 | | -23 | 1.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 202109230001679595 | 寒锐钴业 | 2021-09-23 | 399,840.00 | 4,800 | 7.00 | 3.40% | 264.34 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001679797 | 景嘉微 | 2021-09-23 | 425,964.00 | 3,300 | 7.00 | 3.40% | 281.61 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001679999 | 我武生物 | 2021-09-23 | 324,900.00 | 5,700 | 7.00 | 3.40% | 214.80 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001680101 | 普利制药 | 2021-09-23 | 262,218.00 | 5,800 | 7.00 | 3.40% | 173.36 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001680303 | 华宇软件 | 2021-09-23 | 209,960.00 | 18,100 | 7.00 | 3.40% | 138.81 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001680505 | 三聚环保 | 2021-09-23 | 229,329.00 | 30,700 | 7.00 | 3.40% | 151.61 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001680707 | 捷成股份 | 2021-09-23 | 204,480.00 | 42,600 | 7.00 | 3.40% | 135.18 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001680909 | 国瓷材料 | 2021-09-23 | 743,225.00 | 17,500 | 7.00 | 3.40% | 491.35 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001681111 | 卫宁健康 | 2021-09-23 | 527,933.00 | 37,100 | 7.00 | 3.40% | 349.02 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001681313 | 掌趣科技 | 2021-09-23 | 241,200.00 | 60,000 | 7.00 | 3.40% | 159.46 | - | - |
| 东财证券 | 202109230001681515 | 开山股份 | 2021-09-23 | 150,945.00 | 8,700 | 7.00 | 3.40% | 99.79 | - | - |
| 东财证券 | 202109220003319191 | 易华录 | 2021-09-22 | 194,060.00 | 6,200 | 14.00 | 3.20% | 276.00 | - | - |
| 东财证券 | 202109270000033131 | 迈克生物 | 2021-09-27 | 233,037.00 | 8,100 | 14.00 | 3.40% | 308.13 | - | - |
| 东财证券 | 202110080007277979 | 易华录 | 2021-10-08 | 187,736.00 | 6,200 | 14.00 | 3.20% | 233.63 | - | - |
| 东财证券 | 202110110001961010 | 迈克生物 | 2021-10-11 | 235,548.00 | 8,100 | 14.00 | 3.40% | 311.45 | - | - |
| 东财证券 | 202110120000084848 | 我武生物 | 2021-10-12 | 320,976.00 | 5,400 | 14.00 | 3.40% | 424.40 | - | - |
| 东财证券 | 202110120000085050 | 普利制药 | 2021-10-12 | 265,100.00 | 5,500 | 14.00 | 3.40% | 350.52 | - | - |
| 东财证 | 2021101 | 顺网科 | 2021-10 | 125,24 | 10,100 | 14.00 | 3.40% | 165.60 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 2000008<br>52 | 技 | -12 | 0.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 2021101<br>2000008<br>58 | 三聚环保 | 2021-10<br>-12 | 194,62<br>8.00 | 29,400 | 14.00 | 3.40% | 257.34 | - | - |
| 东财证券 | 2021101<br>2000008<br>60 | 捷成股份 | 2021-10<br>-12 | 181,05<br>0.00 | 42,600 | 14.00 | 3.40% | 239.39 | - | - |
| 东财证券 | 2021101<br>2000008<br>62 | 国瓷材料 | 2021-10<br>-12 | 725,28<br>1.00 | 16,700 | 14.00 | 3.40% | 958.98 | - | - |
| 东财证券 | 2021101<br>2000008<br>64 | 卫宁健康 | 2021-10<br>-12 | 496,26<br>4.00 | 35,600 | 14.00 | 3.40% | 656.17 | - | - |
| 东财证券 | 2021101<br>2000008<br>66 | 掌趣科技 | 2021-10<br>-12 | 220,80<br>0.00 | 57,500 | 14.00 | 3.40% | 291.95 | - | - |
| 东财证券 | 2021101<br>2000008<br>68 | 开山股份 | 2021-10<br>-12 | 143,59<br>0.00 | 8,300 | 14.00 | 3.40% | 189.86 | - | - |
| 东财证券 | 2021101<br>2000008<br>70 | 景嘉微 | 2021-10<br>-12 | 347,45<br>6.00 | 3,200 | 14.00 | 3.40% | 459.41 | - | - |
| 东财证券 | 2021101<br>2000009<br>06 | 寒锐钴业 | 2021-10<br>-12 | 355,77<br>0.00 | 4,500 | 14.00 | 3.40% | 470.41 | - | - |
| 东财证券 | 2021101<br>2000009<br>08 | 利亚德 | 2021-10<br>-12 | 421,88<br>0.00 | 42,400 | 14.00 | 3.40% | 557.82 | - | - |
| 东财证券 | 2021101<br>2000009<br>10 | 华宇软件 | 2021-10<br>-12 | 195,83<br>6.00 | 17,300 | 14.00 | 3.40% | 258.94 | - | - |
| 东财证券 | 2021102<br>2000556<br>46 | 易华录 | 2021-10<br>-22 | 187,05<br>4.00 | 6,200 | 14.00 | 3.20% | 232.78 | - | - |
| 东财证券 | 2021102<br>5000005<br>89 | 东方国信 | 2021-10<br>-25 | 133,20<br>0.00 | 15,000 | 14.00 | 3.40% | 176.12 | - | - |
| 东财证券 | 2021102<br>5000183<br>86 | 迈克生物 | 2021-10<br>-25 | 220,23<br>9.00 | 8,100 | 14.00 | 3.40% | 291.20 | - | - |
| 东财证券 | 2021102<br>6000126<br>78 | 景嘉微 | 2021-10<br>-26 | 426,24<br>0.00 | 3,200 | 14.00 | 3.40% | 563.58 | - | - |
| 东财证券 | 2021102<br>6000126<br>80 | 我武生物 | 2021-10<br>-26 | 301,05<br>0.00 | 5,400 | 14.00 | 3.40% | 398.06 | - | - |
| 东财证券 | 2021102<br>6000126<br>82 | 普利制药 | 2021-10<br>-26 | 253,93<br>5.00 | 5,500 | 14.00 | 3.40% | 335.76 | - | - |
| 东财证券 | 2021102<br>6000126<br>84 | 顺网科技 | 2021-10<br>-26 | 131,90<br>6.00 | 10,100 | 14.00 | 3.40% | 174.41 | - | - |
| 东财证 | 2021102 | 利亚德 | 2021-10 | 408,31 | 42,400 | 14.00 | 3.40% | 539.88 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 600012686 | | -26 | 2.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 2021102600012688 | 寒锐钴业 | 2021-10-26 | 361,440.00 | 4,500 | 14.00 | 3.40% | 477.90 | - | - |
| 东财证券 | 2021102600012690 | 华宇软件 | 2021-10-26 | 184,937.00 | 17,300 | 14.00 | 3.40% | 244.53 | - | - |
| 东财证券 | 2021102600012692 | 卫宁健康 | 2021-10-26 | 443,220.00 | 35,600 | 14.00 | 3.40% | 586.04 | - | - |
| 东财证券 | 2021102600012694 | 掌趣科技 | 2021-10-26 | 216,775.00 | 57,500 | 14.00 | 3.40% | 286.62 | - | - |
| 东财证券 | 2021102600012696 | 开山股份 | 2021-10-26 | 149,566.00 | 8,300 | 14.00 | 3.40% | 197.76 | - | - |
| 东财证券 | 2021102600012698 | 三聚环保 | 2021-10-26 | 176,400.00 | 29,400 | 14.00 | 3.40% | 233.24 | - | - |
| 东财证券 | 2021102600012700 | 捷成股份 | 2021-10-26 | 173,382.00 | 42,600 | 14.00 | 3.40% | 229.25 | - | - |
| 东财证券 | 2021102600012702 | 国瓷材料 | 2021-10-26 | 729,623.00 | 16,700 | 14.00 | 3.40% | 964.72 | - | - |
| 东财证券 | 2021110500065777 | 易华录 | 2021-11-05 | 188,108.00 | 6,200 | 14.00 | 3.20% | 234.09 | - | - |
| 东财证券 | 2021110800016880 | 东方国信 | 2021-11-08 | 141,750.00 | 15,000 | 14.00 | 3.40% | 187.43 | - | - |
| 东财证券 | 2021110800016882 | 迈克生物 | 2021-11-08 | 224,613.00 | 8,100 | 14.00 | 3.40% | 296.99 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017008 | 景嘉微 | 2021-11-09 | 578,624.00 | 3,200 | 14.00 | 3.40% | 765.07 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017010 | 我武生物 | 2021-11-09 | 296,730.00 | 5,400 | 14.00 | 3.40% | 392.34 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017012 | 普利制药 | 2021-11-09 | 275,165.00 | 5,500 | 14.00 | 3.40% | 363.83 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017014 | 顺网科技 | 2021-11-09 | 158,065.00 | 10,100 | 14.00 | 3.40% | 209.00 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017016 | 利亚德 | 2021-11-09 | 429,936.00 | 42,400 | 14.00 | 3.40% | 568.47 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017018 | 寒锐钴业 | 2021-11-09 | 362,025.00 | 4,500 | 14.00 | 3.40% | 478.68 | - | - |
| 东财证 | 2021110 | 华宇软 | 2021-11 | 198,77 | 17,300 | 14.00 | 3.40% | 262.83 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 900017020 | 件 | -09 | 7.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 2021110900017022 | 卫宁健康 | 2021-11-09 | 496,264.00 | 35,600 | 14.00 | 3.40% | 656.17 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017024 | 掌趣科技 | 2021-11-09 | 245,525.00 | 57,500 | 14.00 | 3.40% | 324.64 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017026 | 开山股份 | 2021-11-09 | 150,728.00 | 8,300 | 14.00 | 3.40% | 199.30 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017028 | 三聚环保 | 2021-11-09 | 190,512.00 | 29,400 | 14.00 | 3.40% | 251.90 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017030 | 捷成股份 | 2021-11-09 | 196,386.00 | 42,600 | 14.00 | 3.40% | 259.67 | - | - |
| 东财证券 | 2021110900017032 | 国瓷材料 | 2021-11-09 | 766,029.00 | 16,700 | 14.00 | 3.40% | 1,012.86 | - | - |
| 东财证券 | 2021111900037615 | 易华录 | 2021-11-19 | 206,956.00 | 6,200 | 14.00 | 3.20% | 257.55 | - | - |
| 东财证券 | 2021112200016644 | 东方国信 | 2021-11-22 | 157,950.00 | 15,000 | 14.00 | 3.40% | 208.85 | - | - |
| 东财证券 | 2021112200016646 | 迈克生物 | 2021-11-22 | 230,202.00 | 8,100 | 14.00 | 3.40% | 304.38 | - | - |
| 东财证券 | 2021112300013972 | 三聚环保 | 2021-11-23 | 215,208.00 | 29,400 | 14.00 | 3.40% | 284.55 | - | - |
| 东财证券 | 2021112300013974 | 捷成股份 | 2021-11-23 | 214,278.00 | 42,600 | 14.00 | 3.40% | 283.32 | - | - |
| 东财证券 | 2021112300013976 | 国瓷材料 | 2021-11-23 | 723,110.00 | 16,700 | 14.00 | 3.40% | 956.11 | - | - |
| 东财证券 | 2021112300014494 | 景嘉微 | 2021-11-23 | 652,800.00 | 3,200 | 14.00 | 3.40% | 863.15 | - | - |
| 东财证券 | 2021112300014496 | 我武生物 | 2021-11-23 | 306,504.00 | 5,400 | 14.00 | 3.40% | 405.27 | - | - |
| 东财证券 | 2021112300014498 | 普利制药 | 2021-11-23 | 287,595.00 | 5,500 | 14.00 | 3.40% | 380.26 | - | - |
| 东财证券 | 2021112300014500 | 顺网科技 | 2021-11-23 | 154,227.00 | 10,100 | 14.00 | 3.40% | 203.92 | - | - |
| 东财证券 | 2021112300014502 | 利亚德 | 2021-11-23 | 460,888.00 | 42,400 | 14.00 | 3.40% | 609.40 | - | - |
| 东财证 | 2021112 | 寒锐钴 | 2021-11 | 367,87 | 4,500 | 14.00 | 3.40% | 486.41 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 券 | 300014504 | 业 | -23 | 5.00 | | | | | | |
| 东财证券 | 202111230001450 6 | 华宇软件 | 2021-11-23 | 202,583.00 | 17,300 | 14.00 | 3.40% | 267.86 | - | - |
| 东财证券 | 202111230001450 8 | 卫宁健康 | 2021-11-23 | 547,528.00 | 35,600 | 14.00 | 3.40% | 723.95 | - | - |
| 东财证券 | 202111230001451 0 | 掌趣科技 | 2021-11-23 | 240,925.00 | 57,500 | 14.00 | 3.40% | 318.56 | - | - |
| 东财证券 | 202111230001451 2 | 开山股份 | 2021-11-23 | 133,713.00 | 8,300 | 14.00 | 3.40% | 176.80 | - | - |

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

东财中证500A

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31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 | 6.75% | 5.82% |

东财中证500C

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31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。

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

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。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | | 上年度可比期间<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中金公司-托管户 | 5,582,853.69 | 45,260.18 | 6,548,795.04 | 83,941.34 |
| 东财证券-证券资金户 | 7,098,802.37 | 24,289.01 | 8,929,738.74 | 65,661.57 |

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。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

| 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：张/股） | 总金额 |
| 中金公司 | 002948 | 青岛银行 | 配股发行 | 9,600 | 30,720.00 |

注：本基金上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.10.8 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。

**7.4.11 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。

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

**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688439 | 振华风光 | 2022-08-19 | 6个月 | 科创板新股限售 | 66.99 | 114.86 | 1,419 | 95,058.81 | 162,986.34 | - |
| 688381 | 帝奥微 | 2022-08-15 | 6个月 | 科创板新股限售 | 41.68 | 37.98 | 1,821 | 75,899.28 | 69,161.58 | - |
| 688480 | 赛恩斯 | 2022-11-18 | 6个月 | 科创板新股限售 | 19.18 | 20.19 | 2,302 | 44,152.36 | 46,477.38 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301239 | 普瑞眼科 | 2022-06-22 | 6个月 | 创业板新股限售 | 33.65 | 69.68 | 288 | 9,691.20 | 20,067.84 | - |
| 301269 | 华大九天 | 2022-07-21 | 6个月 | 创业板新股限售 | 32.69 | 87.94 | 222 | 7,257.18 | 19,522.68 | - |
| 301327 | 华宝新能 | 2022-09-08 | 6个月 | 创业板新股限售 | 237.50 | 176.97 | 97 | 23,037.50 | 17,166.09 | - |
| 301175 | 中科环保 | 2022-06-30 | 6个月 | 创业板新股限售 | 3.82 | 6.01 | 2,771 | 10,585.22 | 16,653.71 | - |
| 301301 | 川宁生物 | 2022-12-20 | 6个月 | 创业板新股限售 | 5.00 | 7.53 | 1,756 | 8,780.00 | 13,222.68 | - |
| 301297 | 富乐德 | 2022-12-23 | 6个月 | 创业板新股限售 | 8.48 | 12.99 | 993 | 8,420.64 | 12,899.07 | - |
| 301195 | 北路智控 | 2022-07-25 | 6个月 | 创业板新股限售 | 71.17 | 73.04 | 155 | 11,031.35 | 11,321.20 | - |
| 301230 | 泓博医药 | 2022-10-21 | 6个月 | 创业板新股限售 | 40.00 | 48.32 | 229 | 9,160.00 | 11,065.28 | - |
| 301330 | 熵基科技 | 2022-08-10 | 6个月 | 创业板新 | 43.32 | 31.31 | 322 | 13,949.04 | 10,081.82 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 股限售 | | | | | | |
| 301338 | 凯格精机 | 2022-08-08 | 6个月 | 创业板新股限售 | 46.33 | 48.99 | 197 | 9,127.01 | 9,651.03 | - |
| 301311 | 昆船智能 | 2022-11-23 | 6个月 | 创业板新股限售 | 13.88 | 15.86 | 594 | 8,244.72 | 9,420.84 | - |
| 301273 | 瑞晨环保 | 2022-10-11 | 6个月 | 创业板新股限售 | 37.89 | 37.79 | 244 | 9,245.16 | 9,220.76 | - |
| 301363 | 美好医疗 | 2022-09-28 | 6个月 | 创业板新股限售 | 30.66 | 37.85 | 239 | 7,327.74 | 9,046.15 | - |
| 301396 | 宏景科技 | 2022-11-04 | 6个月 | 创业板新股限售 | 40.13 | 31.90 | 280 | 11,236.40 | 8,932.00 | - |
| 301356 | 天振股份 | 2022-11-03 | 6个月 | 创业板新股限售 | 63.00 | 43.33 | 203 | 12,789.00 | 8,795.99 | - |
| 301152 | 天力锂能 | 2022-08-19 | 6个月 | 创业板新股限售 | 57.00 | 46.64 | 178 | 10,146.00 | 8,301.92 | - |
| 301379 | 天山电子 | 2022-10-19 | 6个月 | 创业板新股限售 | 31.51 | 24.63 | 337 | 10,618.87 | 8,300.31 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301165 | 锐捷网络 | 2022-11-14 | 6个月 | 创业板新股限售 | 32.38 | 31.61 | 259 | 8,386.42 | 8,186.99 | - |
| 301121 | 紫建电子 | 2022-08-01 | 6个月 | 创业板新股限售 | 61.07 | 49.77 | 160 | 9,771.20 | 7,963.20 | - |
| 301296 | 新巨丰 | 2022-08-26 | 6个月 | 创业板新股限售 | 18.19 | 14.90 | 525 | 9,549.75 | 7,822.50 | - |
| 301139 | 元道通信 | 2022-06-30 | 6个月 | 创业板新股限售 | 38.46 | 25.31 | 306 | 11,768.76 | 7,744.86 | - |
| 301377 | 鼎泰高科 | 2022-11-11 | 6个月 | 创业板新股限售 | 22.88 | 17.63 | 438 | 10,021.44 | 7,721.94 | - |
| 301277 | 新天地 | 2022-11-09 | 6个月 | 创业板新股限售 | 27.00 | 25.78 | 299 | 8,073.00 | 7,708.22 | - |
| 301328 | 维峰电子 | 2022-08-30 | 6个月 | 创业板新股限售 | 78.80 | 76.96 | 98 | 7,722.40 | 7,542.08 | - |
| 301132 | 满坤科技 | 2022-08-03 | 6个月 | 创业板新股限售 | 26.80 | 24.48 | 308 | 8,254.40 | 7,539.84 | - |
| 301161 | 唯万密封 | 2022-09-06 | 6个月 | 创业板新 | 18.66 | 21.73 | 346 | 6,456.36 | 7,518.58 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 股限售 | | | | | | |
| 301280 | 珠城科技 | 2022-12-19 | 6个月 | 创业板新股限售 | 67.40 | 44.80 | 167 | 11,255.80 | 7,481.60 | - |
| 301389 | 隆扬电子 | 2022-10-18 | 6个月 | 创业板新股限售 | 22.50 | 17.16 | 432 | 9,720.00 | 7,413.12 | - |
| 301398 | 星源卓镁 | 2022-12-08 | 6个月 | 创业板新股限售 | 34.40 | 28.94 | 255 | 8,772.00 | 7,379.70 | - |
| 301335 | 天元宠物 | 2022-11-11 | 6个月 | 创业板新股限售 | 49.98 | 33.82 | 218 | 10,895.64 | 7,372.76 | - |
| 301227 | 森鹰窗业 | 2022-09-16 | 6个月 | 创业板新股限售 | 38.25 | 29.49 | 247 | 9,447.75 | 7,284.03 | - |
| 301290 | 东星医疗 | 2022-11-23 | 6个月 | 创业板新股限售 | 44.09 | 35.13 | 207 | 9,126.63 | 7,271.91 | - |
| 301365 | 矩阵股份 | 2022-11-14 | 6个月 | 创业板新股限售 | 34.72 | 23.87 | 284 | 9,860.48 | 6,779.08 | - |
| 301171 | 易点天下 | 2022-08-10 | 6个月 | 创业板新股限售 | 18.18 | 17.72 | 378 | 6,872.04 | 6,698.16 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301313 | 凡拓数创 | 2022-09-22 | 6个月 | 创业板新股限售 | 25.25 | 29.14 | 229 | 5,782.25 | 6,673.06 | - |
| 301339 | 通行宝 | 2022-09-02 | 6个月 | 创业板新股限售 | 18.78 | 15.59 | 421 | 7,906.38 | 6,563.39 | - |
| 301359 | 东南电子 | 2022-11-02 | 6个月 | 创业板新股限售 | 20.84 | 19.90 | 328 | 6,835.52 | 6,527.20 | - |
| 301326 | 捷邦科技 | 2022-09-09 | 6个月 | 创业板新股限售 | 51.72 | 36.62 | 177 | 9,154.44 | 6,481.74 | - |
| 301197 | 工大科雅 | 2022-07-29 | 6个月 | 创业板新股限售 | 25.50 | 20.08 | 315 | 8,032.50 | 6,325.20 | - |
| 301368 | 丰立智能 | 2022-12-07 | 6个月 | 创业板新股限售 | 22.33 | 18.52 | 337 | 7,525.21 | 6,241.24 | - |
| 301270 | 汉仪股份 | 2022-08-19 | 6个月 | 创业板新股限售 | 25.68 | 28.37 | 210 | 5,392.80 | 5,957.70 | - |
| 301282 | 金禄电子 | 2022-08-18 | 6个月 | 创业板新股限售 | 30.38 | 25.25 | 227 | 6,896.26 | 5,731.75 | - |
| 301285 | 鸿日达 | 2022-09-21 | 6个月 | 创业板新 | 14.60 | 12.60 | 453 | 6,613.80 | 5,707.80 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 股限售 | | | | | | |
| 301300 | 远翔新材 | 2022-08-09 | 6个月 | 创业板新股限售 | 36.15 | 29.37 | 194 | 7,013.10 | 5,697.78 | - |
| 301231 | 荣信文化 | 2022-08-31 | 6个月 | 创业板新股限售 | 25.49 | 20.38 | 275 | 7,009.75 | 5,604.50 | - |
| 301176 | 逸豪新材 | 2022-09-21 | 6个月 | 创业板新股限售 | 23.88 | 16.89 | 330 | 7,880.40 | 5,573.70 | - |
| 301233 | 盛帮股份 | 2022-06-24 | 6个月 | 创业板新股限售 | 41.52 | 34.30 | 158 | 6,560.16 | 5,419.40 | - |
| 301388 | 欣灵电气 | 2022-10-26 | 6个月 | 创业板新股限售 | 25.88 | 21.60 | 248 | 6,418.24 | 5,356.80 | - |
| 301265 | 华新环保 | 2022-12-08 | 6个月 | 创业板新股限售 | 13.28 | 11.40 | 455 | 6,042.40 | 5,187.00 | - |
| 301316 | 慧博云通 | 2022-09-29 | 6个月 | 创业板新股限售 | 7.60 | 14.32 | 359 | 2,728.40 | 5,140.88 | - |
| 301349 | 信德新材 | 2022-08-30 | 6个月 | 创业板新股限售 | 138.88 | 103.52 | 49 | 6,805.12 | 5,072.48 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 301319 | 唯特偶 | 2022-09-22 | 6个月 | 创业板新股限售 | 47.75 | 53.27 | 94 | 4,488.50 | 5,007.38 | - |
| 301318 | 维海德 | 2022-08-03 | 6个月 | 创业板新股限售 | 64.68 | 41.74 | 112 | 7,244.16 | 4,674.88 | - |
| 301276 | 嘉曼服饰 | 2022-09-01 | 6个月 | 创业板新股限售 | 40.66 | 22.61 | 193 | 7,847.38 | 4,363.73 | - |
| 301309 | 万得凯 | 2022-09-08 | 6个月 | 创业板新股限售 | 39.00 | 24.46 | 129 | 5,031.00 | 3,155.34 | - |

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600038 | 中直股份 | 2022-12-26 | 重大事项停牌 | 46.41 | 2023-01-10 | 51.05 | 9,900 | 570,177.38 | 459,459.00 | - |
| 300850 | 新强联 | 2022-12-3 | 重大事 | 53.28 | 2023-01-1 | 56.88 | 6,600 | 391,186.00 | 351,648.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 0 | 项停牌 | | 0 | | | | | |

注：本基金截至2022年12月31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。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末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。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末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。

**7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 出借到期日 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000009 | 中国宝安 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 12.09 | 26,700 | 322,803.00 |
| 2 | 000012 | 南 玻Ａ | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 6.71 | 17,800 | 119,438.00 |
| 3 | 000027 | 深圳能源 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 6.36 | 24,600 | 156,456.00 |
| 4 | 000031 | 大悦城 | 2023年01月10日-2023年01月 | 3.76 | 16,600 | 62,416.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 10日 | | | |
| 5 | 000050 | 深天马A | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.66 | 15,900 | 137,694.00 |
| 6 | 000060 | 中金岭南 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.10 | 33,900 | 138,990.00 |
| 7 | 000089 | 深圳机场 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.86 | 13,300 | 104,538.00 |
| 8 | 000156 | 华数传媒 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.49 | 12,000 | 89,880.00 |
| 9 | 000401 | 冀东水泥 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.23 | 13,800 | 113,574.00 |
| 10 | 000415 | 渤海租赁 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.21 | 32,100 | 70,941.00 |
| 11 | 000540 | 中天金融 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 1.51 | 63,600 | 96,036.00 |
| 12 | 000559 | 万向钱潮 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.87 | 17,100 | 83,277.00 |
| 13 | 000563 | 陕国投A | 2023年01 | 3.03 | 25,700 | 77,871.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月10日-2023年01月10日 | | | |
| 14 | 000591 | 太阳能 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.33 | 30,400 | 222,832.00 |
| 15 | 000598 | 兴蓉环境 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.89 | 23,200 | 113,448.00 |
| 16 | 000623 | 吉林敖东 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 14.99 | 12,000 | 179,880.00 |
| 17 | 000629 | 钒钛股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.73 | 55,800 | 263,934.00 |
| 18 | 000630 | 铜陵有色 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 3.12 | 95,600 | 298,272.00 |
| 19 | 000636 | 风华高科 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 14.83 | 10,500 | 155,715.00 |
| 20 | 000656 | 金科股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 1.91 | 55,400 | 105,814.00 |
| 21 | 000683 | 远兴能源 | 2023年01月10日-2023年01月 | 7.84 | 32,900 | 257,936.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 10日 | | | |
| 22 | 000825 | 太钢不锈 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.32 | 29,700 | 128,304.00 |
| 23 | 000878 | 云南铜业 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 11.75 | 15,600 | 183,300.00 |
| 24 | 000883 | 湖北能源 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.20 | 25,500 | 107,100.00 |
| 25 | 000887 | 中鼎股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 14.47 | 10,200 | 147,594.00 |
| 26 | 000937 | 冀中能源 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 6.36 | 14,200 | 90,312.00 |
| 27 | 000960 | 锡业股份 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 14.10 | 10,000 | 141,000.00 |
| 28 | 000961 | 中南建设 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.19 | 24,800 | 54,312.00 |
| 29 | 000967 | 盈峰环境 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.54 | 16,500 | 74,910.00 |
| 30 | 000970 | 中科三环 | 2023年01 | 13.64 | 13,000 | 177,320.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月13日-2023年01月13日 | | | |
| 31 | 000975 | 银泰黄金 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 11.04 | 23,100 | 255,024.00 |
| 32 | 002002 | 鸿达兴业 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 3.24 | 32,400 | 104,976.00 |
| 33 | 002010 | 传化智联 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.34 | 18,200 | 97,188.00 |
| 34 | 002030 | 达安基因 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 15.56 | 12,700 | 197,612.00 |
| 35 | 002078 | 太阳纸业 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 11.52 | 20,900 | 240,768.00 |
| 36 | 002092 | 中泰化学 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.46 | 27,000 | 201,420.00 |
| 37 | 002127 | 南极电商 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.81 | 25,400 | 122,174.00 |
| 38 | 002131 | 利欧股份 | 2023年01月10日-2023年01月 | 1.77 | 87,600 | 155,052.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 10日 | | | |
| 39 | 002146 | 荣盛发展 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.17 | 28,200 | 61,194.00 |
| 40 | 002156 | 通富微电 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 16.48 | 11,800 | 194,464.00 |
| 41 | 002183 | 怡 亚 通 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 6.43 | 23,600 | 151,748.00 |
| 42 | 002191 | 劲嘉股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.23 | 13,300 | 96,159.00 |
| 43 | 002195 | 二三四五 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 2.01 | 76,800 | 154,368.00 |
| 44 | 002203 | 海亮股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 11.30 | 15,300 | 172,890.00 |
| 45 | 002212 | 天融信 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 9.99 | 15,300 | 152,847.00 |
| 46 | 002244 | 滨江集团 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.83 | 16,100 | 142,163.00 |
| 47 | 002249 | 大洋电机 | 2023年01 | 5.12 | 21,600 | 110,592.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月10日-2023年01月10日 | | | |
| 48 | 002373 | 千方科技 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.92 | 14,300 | 127,556.00 |
| 49 | 002385 | 大北农 | 2023年01月10日-2023年01月13日 | 8.90 | 42,900 | 381,810.00 |
| 50 | 002408 | 齐翔腾达 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 7.04 | 22,800 | 160,512.00 |
| 51 | 002422 | 科伦药业 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 26.61 | 14,700 | 391,167.00 |
| 52 | 002429 | 兆驰股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 3.49 | 29,300 | 102,257.00 |
| 53 | 002434 | 万里扬 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.05 | 10,200 | 82,110.00 |
| 54 | 002468 | 申通快递 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 10.33 | 10,200 | 105,366.00 |
| 55 | 002497 | 雅化集团 | 2023年01月10日-2023年01月 | 23.25 | 14,900 | 346,425.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 10日 | | | |
| 56 | 002500 | 山西证券 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.30 | 27,900 | 147,870.00 |
| 57 | 002506 | 协鑫集成 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.91 | 53,100 | 154,521.00 |
| 58 | 002511 | 中顺洁柔 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 13.74 | 10,500 | 144,270.00 |
| 59 | 002531 | 天顺风能 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 15.13 | 11,600 | 175,508.00 |
| 60 | 002532 | 天山铝业 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.72 | 30,200 | 233,144.00 |
| 61 | 002563 | 森马服饰 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.24 | 10,400 | 54,496.00 |
| 62 | 002603 | 以岭药业 | 2023年01月11日-2023年01月11日 | 29.96 | 10,800 | 323,568.00 |
| 63 | 002624 | 完美世界 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 12.72 | 17,600 | 223,872.00 |
| 64 | 002673 | 西部证券 | 2023年01 | 6.09 | 34,800 | 211,932.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月10日-2023年01月10日 | | | |
| 65 | 002701 | 奥瑞金 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.05 | 23,300 | 117,665.00 |
| 66 | 002739 | 万达电影 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 14.00 | 14,100 | 197,400.00 |
| 67 | 002745 | 木林森 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.11 | 11,500 | 93,265.00 |
| 68 | 002939 | 长城证券 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.28 | 15,700 | 129,996.00 |
| 69 | 002948 | 青岛银行 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 3.36 | 22,800 | 76,608.00 |
| 70 | 002958 | 青农商行 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.89 | 50,400 | 145,656.00 |
| 71 | 003035 | 南网能源 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.67 | 14,700 | 83,349.00 |
| 72 | 300003 | 乐普医疗 | 2023年01月10日-2023年01月 | 22.97 | 17,000 | 390,490.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 10日 | | | |
| 73 | 300009 | 安科生物 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 9.36 | 10,500 | 98,280.00 |
| 74 | 300024 | 机器人 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.98 | 16,000 | 143,680.00 |
| 75 | 300026 | 红日药业 | 2023年01月10日-2023年01月13日 | 5.68 | 28,200 | 160,176.00 |
| 76 | 300058 | 蓝色光标 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.05 | 32,300 | 163,115.00 |
| 77 | 300070 | 碧水源 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.73 | 32,900 | 155,617.00 |
| 78 | 300072 | 海新能科 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.36 | 21,300 | 92,868.00 |
| 79 | 300144 | 宋城演艺 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 14.60 | 4,400 | 64,240.00 |
| 80 | 300146 | 汤臣倍健 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 22.82 | 13,200 | 301,224.00 |
| 81 | 300168 | 万达信息 | 2023年01 | 8.43 | 15,400 | 129,822.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月10日-2023年01月10日 | | | |
| 82 | 300182 | 捷成股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.47 | 26,700 | 119,349.00 |
| 83 | 300212 | 易华录 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 20.41 | 5,200 | 106,132.00 |
| 84 | 300251 | 光线传媒 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.66 | 15,200 | 131,632.00 |
| 85 | 300253 | 卫宁健康 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 10.28 | 22,200 | 228,216.00 |
| 86 | 300257 | 开山股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 15.00 | 5,100 | 76,500.00 |
| 87 | 300285 | 国瓷材料 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 27.57 | 10,400 | 286,728.00 |
| 88 | 300373 | 扬杰科技 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 52.60 | 3,400 | 178,840.00 |
| 89 | 300463 | 迈克生物 | 2023年01月10日-2023年01月 | 17.30 | 5,500 | 95,150.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 10日 | | | |
| 90 | 300482 | 万孚生物 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 31.87 | 3,400 | 108,358.00 |
| 91 | 300630 | 普利制药 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 24.66 | 3,400 | 83,844.00 |
| 92 | 300676 | 华大基因 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 51.69 | 3,200 | 165,408.00 |
| 93 | 300677 | 英科医疗 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 21.03 | 5,900 | 124,077.00 |
| 94 | 300682 | 朗新科技 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 21.98 | 6,800 | 149,464.00 |
| 95 | 300724 | 捷佳伟创 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 114.02 | 3,600 | 410,472.00 |
| 96 | 300776 | 帝尔激光 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 126.00 | 1,100 | 138,600.00 |
| 97 | 300850 | 新强联 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 53.28 | 2,500 | 133,200.00 |
| 98 | 300869 | 康泰医学 | 2023年01 | 32.57 | 2,000 | 65,140.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月10日-2023年01月10日 | | | |
| 99 | 300888 | 稳健医疗 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 71.50 | 1,600 | 114,400.00 |
| 100 | 301029 | 怡合达 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 65.74 | 1,200 | 78,888.00 |
| 101 | 600006 | 东风汽车 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.58 | 10,400 | 58,032.00 |
| 102 | 600008 | 首创环保 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.83 | 57,100 | 161,593.00 |
| 103 | 600021 | 上海电力 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 10.01 | 14,600 | 146,146.00 |
| 104 | 600026 | 中远海能 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 12.05 | 18,000 | 216,900.00 |
| 105 | 600056 | 中国医药 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 17.23 | 10,000 | 172,300.00 |
| 106 | 600060 | 海信视像 | 2023年01月10日-2023年01月 | 13.54 | 10,200 | 138,108.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 10日 | | | |
| 107 | 600064 | 南京高科 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 6.61 | 15,700 | 103,777.00 |
| 108 | 600066 | 宇通客车 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.51 | 17,200 | 129,172.00 |
| 109 | 600079 | 人福医药 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 23.89 | 14,800 | 353,572.00 |
| 110 | 600095 | 湘财股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.56 | 11,100 | 83,916.00 |
| 111 | 600143 | 金发科技 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 9.69 | 24,100 | 233,529.00 |
| 112 | 600155 | 华创阳安 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 6.50 | 14,600 | 94,900.00 |
| 113 | 600157 | 永泰能源 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 1.53 | 288,300 | 441,099.00 |
| 114 | 600161 | 天坛生物 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 23.73 | 10,600 | 251,538.00 |
| 115 | 600167 | 联美控股 | 2023年01 | 6.32 | 11,800 | 74,576.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月10日-2023年01月10日 | | | |
| 116 | 600170 | 上海建工 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.60 | 39,600 | 102,960.00 |
| 117 | 600297 | 广汇汽车 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 2.10 | 26,900 | 56,490.00 |
| 118 | 600339 | 中油工程 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.98 | 21,700 | 64,666.00 |
| 119 | 600372 | 中航电子 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 15.97 | 10,000 | 159,700.00 |
| 120 | 600380 | 健康元 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 11.29 | 15,000 | 169,350.00 |
| 121 | 600409 | 三友化工 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 6.61 | 16,000 | 105,760.00 |
| 122 | 600415 | 小商品城 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.24 | 35,600 | 186,544.00 |
| 123 | 600418 | 江淮汽车 | 2023年01月10日-2023年01月 | 13.13 | 22,600 | 296,738.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 10日 | | | |
| 124 | 600435 | 北方导航 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 11.60 | 13,500 | 156,600.00 |
| 125 | 600499 | 科达制造 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 14.21 | 17,600 | 250,096.00 |
| 126 | 600516 | 方大炭素 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 6.12 | 29,600 | 181,152.00 |
| 127 | 600517 | 国网英大 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.84 | 22,200 | 107,448.00 |
| 128 | 600535 | 天士力 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 10.76 | 11,600 | 124,816.00 |
| 129 | 600546 | 山煤国际 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 14.49 | 12,800 | 185,472.00 |
| 130 | 600556 | 天下秀 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 6.74 | 11,700 | 78,858.00 |
| 131 | 600567 | 山鹰国际 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.48 | 41,900 | 103,912.00 |
| 132 | 600580 | 卧龙电驱 | 2023年01 | 12.46 | 11,900 | 148,274.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月10日-2023年01月10日 | | | |
| 133 | 600582 | 天地科技 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.20 | 21,400 | 111,280.00 |
| 134 | 600663 | 陆家嘴 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 9.74 | 11,800 | 114,932.00 |
| 135 | 600673 | 东阳光 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 8.69 | 19,500 | 169,455.00 |
| 136 | 600704 | 物产中大 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.81 | 40,400 | 194,324.00 |
| 137 | 600705 | 中航产融 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 3.28 | 68,700 | 225,336.00 |
| 138 | 600707 | 彩虹股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.14 | 18,600 | 77,004.00 |
| 139 | 600728 | 佳都科技 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.28 | 18,200 | 96,096.00 |
| 140 | 600737 | 中粮糖业 | 2023年01月13日-2023年01月 | 6.94 | 14,300 | 99,242.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 13日 | | | |
| 141 | 600755 | 厦门国贸 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.14 | 10,000 | 71,400.00 |
| 142 | 600787 | 中储股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.97 | 11,300 | 56,161.00 |
| 143 | 600839 | 四川长虹 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.64 | 47,900 | 126,456.00 |
| 144 | 600848 | 上海临港 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 11.92 | 12,400 | 147,808.00 |
| 145 | 600859 | 王府井 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 28.14 | 10,300 | 289,842.00 |
| 146 | 600863 | 内蒙华电 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 3.49 | 42,300 | 147,627.00 |
| 147 | 600871 | 石化油服 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 1.98 | 52,800 | 104,544.00 |
| 148 | 600879 | 航天电子 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 6.80 | 28,200 | 191,760.00 |
| 149 | 600906 | 财达证券 | 2023年01 | 7.57 | 16,800 | 127,176.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月10日-2023年01月10日 | | | |
| 150 | 600909 | 华安证券 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 4.59 | 36,500 | 167,535.00 |
| 151 | 600959 | 江苏有线 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.97 | 38,900 | 115,533.00 |
| 152 | 600998 | 九州通 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 13.04 | 12,100 | 157,784.00 |
| 153 | 601005 | 重庆钢铁 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 1.58 | 87,000 | 137,460.00 |
| 154 | 601106 | 中国一重 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.93 | 35,600 | 104,308.00 |
| 155 | 601162 | 天风证券 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 2.87 | 93,000 | 266,910.00 |
| 156 | 601168 | 西部矿业 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 10.20 | 10,000 | 102,000.00 |
| 157 | 601179 | 中国西电 | 2023年01月13日-2023年01月 | 4.61 | 10,000 | 46,100.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 13日 | | | |
| 158 | 601228 | 广州港 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 3.15 | 13,700 | 43,155.00 |
| 159 | 601233 | 桐昆股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 14.45 | 21,900 | 316,455.00 |
| 160 | 601333 | 广深铁路 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.27 | 44,000 | 99,880.00 |
| 161 | 601568 | 北元集团 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.67 | 15,400 | 87,318.00 |
| 162 | 601608 | 中信重工 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 3.49 | 22,500 | 78,525.00 |
| 163 | 601611 | 中国核建 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 7.60 | 10,300 | 78,280.00 |
| 164 | 601636 | 旗滨集团 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 11.39 | 20,800 | 236,912.00 |
| 165 | 601666 | 平煤股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 10.81 | 18,000 | 194,580.00 |
| 166 | 601696 | 中银证券 | 2023年01 | 10.57 | 22,300 | 235,711.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月13日-2023年01月13日 | | | |
| 167 | 601717 | 郑煤机 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 11.16 | 11,900 | 132,804.00 |
| 168 | 601718 | 际华集团 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.91 | 34,200 | 99,522.00 |
| 169 | 601778 | 晶科科技 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.50 | 22,500 | 123,750.00 |
| 170 | 601828 | 美凯龙 | 2023年01月16日-2023年01月16日 | 4.69 | 14,000 | 65,660.00 |
| 171 | 601866 | 中远海发 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.42 | 51,400 | 124,388.00 |
| 172 | 601872 | 招商轮船 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 5.59 | 42,100 | 235,339.00 |
| 173 | 601880 | 辽港股份 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 1.62 | 97,700 | 158,274.00 |
| 174 | 601928 | 凤凰传媒 | 2023年01月13日-2023年01月 | 7.92 | 10,200 | 80,784.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 13日 | | | |
| 175 | 601991 | 大唐发电 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 2.79 | 32,100 | 89,559.00 |
| 176 | 688006 | 杭可科技 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 43.77 | 1,500 | 65,655.00 |
| 177 | 688029 | 南微医学 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 82.13 | 1,200 | 98,556.00 |
| 178 | 688063 | 派能科技 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 315.65 | 1,200 | 378,780.00 |
| 179 | 688208 | 道通科技 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 31.55 | 3,500 | 110,425.00 |
| 180 | 688289 | 圣湘生物 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 21.95 | 3,800 | 83,410.00 |
| 181 | 688690 | 纳微科技 | 2023年01月10日-2023年01月10日 | 51.77 | 2,000 | 103,540.00 |
| 182 | 688777 | 中控技术 | 2023年01月13日-2023年01月13日 | 90.83 | 4,500 | 408,735.00 |
| 183 | 688819 | 天能股份 | 2023年01 | 36.74 | 1,700 | 62,458.00 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 月10日-2023年01月10日 | | | |
| 合计 | | | | | 4,277,100 | 27,969,291.00 |

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

**7.4.13 金融工具风险及管理**

**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为指数基金，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。

**7.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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）。

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**7.4.13.3 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。

**7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过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。

**7.4.13.4 市场风险**

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

**7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或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等。

**7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

| 本期末2022年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 12,681,656.06 | - | - | - | 12,681,656.06 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 214,549,149.48 | 214,549,149.48 |
| 应收申购款 | - | - | - | 33,847.77 | 33,847.77 |
| 其他资产 | - | - | - | 5,767.69 | 5,767.69 |
| 资产总计 | 12,681,656.06 | - | - | 214,588,764.94 | 227,270,421.00 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 144,253.67 | 144,253.67 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 96,640.27 | 96,640.27 |
| 应付托管费 | - | - | - | 9,664.04 | 9,664.04 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 21,263.10 | 21,263.10 |
| 应交税费 | - | - | - | 1,359.01 | 1,359.01 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 其他负债 | - | - | - | 265,412.84 | 265,412.84 |
| 负债总计 | - | - | - | 538,592.93 | 538,592.93 |
| 利率敏感度缺口 | 12,681,656.06 | - | - | 214,050,172.01 | 226,731,828.07 |
| 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 |
| 应收申购款 | - | - | - | 53,988.64 | 53,988.64 |
| 其他资产 | - | - | - | 2,867.18 | 2,867.18 |
| 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。

**7.4.13.4.1.2 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）。

**7.4.13.4.2 外汇风险**

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

**7.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

**7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022年12月31日 | | 上年度末<br>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 | 214,549,149.48 | 94.63 | 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 | 214,549,149.48 | 94.63 | 273,513,444.68 | 95.00 |

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
| | 业绩比较基准上升5% | 11,262,967.59 | 13,824,407.21 |
| | 业绩比较基准下降5% | -11,262,967.59 | -13,824,407.21 |

**7.4.14 公允价值**

**7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法**

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

第一层次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。

**7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**

**7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

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

| | 2022年12月31日 | 2021年12月31日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 213,011,856.29 | 271,504,675.54 |
| 第二层次 | 811,107.00 | 713,623.07 |
| 第三层次 | 726,186.19 | 1,295,146.07 |
| 合计 | 214,549,149.48 | 273,513,444.68 |

**7.4.14.2.2 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。

**7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况**

**7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | 1,295,146.07 | 1,295,146.07 |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 690,919.32 | 690,919.32 |
| 转出第三层次 | - | 1,295,146.07 | 1,295,146.07 |
| 当期利得或损失总额 | - | 35,266.87 | 35,266.87 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 35,266.87 | 35,266.87 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 726,186.19 | 726,186.19 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | 35,266.87 | 35,266.87 |
| 项目 | 上年度可比同期<br>2021年01月20日（基金合同生效日）至2021年12月31日 | | |
| | 交易性金融资产 | | 合计 |
| | 债券投资 | 股票投资 | |
| 期初余额 | - | - | - |
| 当期购买 | - | - | - |
| 当期出售/结算 | - | - | - |
| 转入第三层次 | - | 636,534.05 | 636,534.05 |
| 转出第三层次 | - | - | - |
| 当期利得或损失总额 | - | 658,612.02 | 658,612.02 |
| 其中：计入损益的利得或损失 | - | 658,612.02 | 658,612.02 |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | - | - | - |
| 期末余额 | - | 1,295,146.07 | 1,295,146.07 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | - | 658,612.02 | 658,612.02 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 限售股票 | 726,186.19 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 0.1891-2.4756 | 负相关 |
| 项目 | 上年度末公允价值 | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 | | |
| | | | 名称 | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 限售股票 | 1,295,146.07 | 平均价格亚式期权模型 | 预期波动率 | 0.3138-2.7417 | 负相关 |

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

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

**7.4.14.4 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银行存款、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 214,549,149.48 | 94.40 |
| | 其中：股票 | 214,549,149.48 | 94.40 |
| 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 | 12,681,656.06 | 5.58 |
| 8 | 其他各项资产 | 39,615.46 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 227,270,421.00 | 100.00 |

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为27,969,291.00元，占基金资产净值的比例为12.34%。

**8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

**8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合**

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 2,041,508.80 | 0.90 |
| B | 采矿业 | 9,360,425.95 | 4.13 |
| C | 制造业 | 129,884,684.29 | 57.29 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,144,961.10 | 3.15 |
| E | 建筑业 | 1,895,176.00 | 0.84 |
| F | 批发和零售业 | 9,068,629.00 | 4.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,758,204.00 | 2.10 |
| H | 住宿和餐饮业 | 558,967.20 | 0.25 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 15,263,630.11 | 6.73 |
| J | 金融业 | 18,579,472.39 | 8.19 |
| K | 房地产业 | 4,388,068.10 | 1.94 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,487,308.00 | 1.10 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,343,185.40 | 1.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,194,043.20 | 0.53 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| Q | 卫生和社会工作 | 422,184.00 | 0.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,823,889.00 | 1.25 |
| S | 综合 | 1,276,342.00 | 0.56 |
| | 合计 | 213,490,678.54 | 94.16 |

**8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合**

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 789,096.38 | 0.35 |
| 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 | 11,014.08 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 328.00 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 138,449.92 | 0.06 |
| J | 金融业 | 35.70 | 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 | 30,743.43 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 63,131.09 | 0.03 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 20,067.84 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,604.50 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,058,470.94 | 0.47 |

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002340 | 格林美 | 172,300 | 1,280,189.00 | 0.56 |
| 2 | 300012 | 华测检测 | 56,400 | 1,257,720.00 | 0.55 |
| 3 | 600157 | 永泰能源 | 745,300 | 1,140,309.00 | 0.50 |
| 4 | 002384 | 东山精密 | 45,900 | 1,135,107.00 | 0.50 |
| 5 | 300724 | 捷佳伟创 | 9,300 | 1,060,386.00 | 0.47 |
| 6 | 688777 | 中控技术 | 11,653 | 1,058,441.99 | 0.47 |
| 7 | 603613 | 国联股份 | 11,675 | 1,032,537.00 | 0.46 |
| 8 | 688122 | 西部超导 | 10,884 | 1,030,605.96 | 0.45 |
| 9 | 300003 | 乐普医疗 | 44,200 | 1,015,274.00 | 0.45 |
| 10 | 688063 | 派能科技 | 3,214 | 1,014,499.10 | 0.45 |
| 11 | 002422 | 科伦药业 | 38,000 | 1,011,180.00 | 0.45 |
| 12 | 600487 | 亨通光电 | 66,200 | 996,972.00 | 0.44 |
| 13 | 002385 | 大北农 | 111,100 | 988,790.00 | 0.44 |
| 14 | 002966 | 苏州银行 | 122,970 | 956,706.60 | 0.42 |
| 15 | 603345 | 安井食品 | 5,900 | 955,092.00 | 0.42 |
| 16 | 603606 | 东方电缆 | 13,800 | 936,054.00 | 0.41 |
| 17 | 600885 | 宏发股份 | 27,980 | 934,811.80 | 0.41 |
| 18 | 600765 | 中航重机 | 29,660 | 922,129.40 | 0.41 |
| 19 | 600079 | 人福医药 | 38,300 | 914,987.00 | 0.40 |
| 20 | 600096 | 云天化 | 43,100 | 906,824.00 | 0.40 |
| 21 | 002497 | 雅化集团 | 38,700 | 899,775.00 | 0.40 |
| 22 | 601555 | 东吴证券 | 134,360 | 877,370.80 | 0.39 |
| 23 | 600352 | 浙江龙盛 | 87,300 | 864,270.00 | 0.38 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 24 | 002625 | 光启技术 | 50,600 | 861,212.00 | 0.38 |
| 25 | 002407 | 多氟多 | 25,700 | 856,324.00 | 0.38 |
| 26 | 002603 | 以岭药业 | 28,055 | 840,527.80 | 0.37 |
| 27 | 000009 | 中国宝安 | 69,200 | 836,628.00 | 0.37 |
| 28 | 601058 | 赛轮轮胎 | 82,182 | 823,463.64 | 0.36 |
| 29 | 002738 | 中矿资源 | 12,300 | 819,918.00 | 0.36 |
| 30 | 601233 | 桐昆股份 | 56,600 | 817,870.00 | 0.36 |
| 31 | 600988 | 赤峰黄金 | 44,639 | 805,733.95 | 0.36 |
| 32 | 603605 | 珀莱雅 | 4,800 | 803,904.00 | 0.35 |
| 33 | 603688 | 石英股份 | 6,100 | 801,052.00 | 0.35 |
| 34 | 600489 | 中金黄金 | 97,600 | 799,344.00 | 0.35 |
| 35 | 600298 | 安琪酵母 | 17,474 | 790,174.28 | 0.35 |
| 36 | 002028 | 思源电气 | 20,600 | 787,332.00 | 0.35 |
| 37 | 300146 | 汤臣倍健 | 34,200 | 780,444.00 | 0.34 |
| 38 | 600536 | 中国软件 | 13,330 | 777,538.90 | 0.34 |
| 39 | 000807 | 云铝股份 | 69,800 | 776,176.00 | 0.34 |
| 40 | 601108 | 财通证券 | 109,000 | 776,080.00 | 0.34 |
| 41 | 688390 | 固德威 | 2,398 | 774,769.82 | 0.34 |
| 42 | 603939 | 益丰药房 | 12,100 | 772,464.00 | 0.34 |
| 43 | 300390 | 天华超净 | 13,800 | 771,144.00 | 0.34 |
| 44 | 600418 | 江淮汽车 | 58,600 | 769,418.00 | 0.34 |
| 45 | 300144 | 宋城演艺 | 52,600 | 767,960.00 | 0.34 |
| 46 | 300073 | 当升科技 | 13,600 | 767,040.00 | 0.34 |
| 47 | 300037 | 新宙邦 | 17,440 | 758,116.80 | 0.33 |
| 48 | 600399 | 抚顺特钢 | 52,900 | 756,999.00 | 0.33 |
| 49 | 600141 | 兴发集团 | 26,100 | 756,900.00 | 0.33 |
| 50 | 300699 | 光威复材 | 10,400 | 751,400.00 | 0.33 |
| 51 | 600859 | 王府井 | 26,700 | 751,338.00 | 0.33 |
| 52 | 000630 | 铜陵有色 | 239,100 | 745,992.00 | 0.33 |
| 53 | 603517 | 绝味食品 | 12,200 | 745,298.00 | 0.33 |
| 54 | 300285 | 国瓷材料 | 26,900 | 741,633.00 | 0.33 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 55 | 601077 | 渝农商行 | 207,700 | 733,181.00 | 0.32 |
| 56 | 300568 | 星源材质 | 34,400 | 731,344.00 | 0.32 |
| 57 | 600873 | 梅花生物 | 71,400 | 726,852.00 | 0.32 |
| 58 | 600563 | 法拉电子 | 4,500 | 719,460.00 | 0.32 |
| 59 | 002185 | 华天科技 | 86,000 | 712,940.00 | 0.31 |
| 60 | 603456 | 九洲药业 | 16,800 | 712,824.00 | 0.31 |
| 61 | 002138 | 顺络电子 | 27,000 | 706,860.00 | 0.31 |
| 62 | 603816 | 顾家家居 | 16,500 | 704,715.00 | 0.31 |
| 63 | 600160 | 巨化股份 | 45,300 | 702,603.00 | 0.31 |
| 64 | 603589 | 口子窖 | 12,100 | 697,807.00 | 0.31 |
| 65 | 601128 | 常熟银行 | 91,900 | 693,845.00 | 0.31 |
| 66 | 000783 | 长江证券 | 129,900 | 692,367.00 | 0.31 |
| 67 | 600153 | 建发股份 | 50,400 | 687,960.00 | 0.30 |
| 68 | 002192 | 融捷股份 | 7,000 | 685,300.00 | 0.30 |
| 69 | 688099 | 晶晨股份 | 9,698 | 683,805.98 | 0.30 |
| 70 | 000629 | 钒钛股份 | 144,300 | 682,539.00 | 0.30 |
| 71 | 300357 | 我武生物 | 12,306 | 678,060.60 | 0.30 |
| 72 | 605358 | 立昂微 | 15,884 | 676,658.40 | 0.30 |
| 73 | 601699 | 潞安环能 | 40,100 | 675,685.00 | 0.30 |
| 74 | 601162 | 天风证券 | 232,600 | 667,562.00 | 0.29 |
| 75 | 000683 | 远兴能源 | 85,000 | 666,400.00 | 0.29 |
| 76 | 601607 | 上海医药 | 37,300 | 665,059.00 | 0.29 |
| 77 | 603596 | 伯特利 | 8,300 | 662,340.00 | 0.29 |
| 78 | 600392 | 盛和资源 | 47,000 | 658,000.00 | 0.29 |
| 79 | 688567 | 孚能科技 | 24,339 | 657,883.17 | 0.29 |
| 80 | 002568 | 百润股份 | 17,600 | 657,536.00 | 0.29 |
| 81 | 600161 | 天坛生物 | 27,600 | 654,948.00 | 0.29 |
| 82 | 600521 | 华海药业 | 29,900 | 653,614.00 | 0.29 |
| 83 | 000932 | 华菱钢铁 | 139,000 | 653,300.00 | 0.29 |
| 84 | 600109 | 国金证券 | 75,000 | 652,500.00 | 0.29 |
| 85 | 601168 | 西部矿业 | 63,900 | 651,780.00 | 0.29 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 86 | 600499 | 科达制造 | 45,800 | 650,818.00 | 0.29 |
| 87 | 000831 | 中国稀土 | 19,700 | 647,736.00 | 0.29 |
| 88 | 600486 | 扬农化工 | 6,200 | 644,180.00 | 0.28 |
| 89 | 002223 | 鱼跃医疗 | 20,200 | 643,572.00 | 0.28 |
| 90 | 600027 | 华电国际 | 109,400 | 643,272.00 | 0.28 |
| 91 | 002797 | 第一创业 | 112,800 | 635,064.00 | 0.28 |
| 92 | 603077 | 和邦生物 | 207,400 | 630,496.00 | 0.28 |
| 93 | 600862 | 中航高科 | 28,000 | 624,120.00 | 0.28 |
| 94 | 002078 | 太阳纸业 | 54,100 | 623,232.00 | 0.27 |
| 95 | 000999 | 华润三九 | 13,300 | 622,573.00 | 0.27 |
| 96 | 688385 | 复旦微电 | 8,882 | 620,052.42 | 0.27 |
| 97 | 000975 | 银泰黄金 | 55,900 | 617,136.00 | 0.27 |
| 98 | 601636 | 旗滨集团 | 54,000 | 615,060.00 | 0.27 |
| 99 | 002294 | 信立泰 | 18,700 | 614,295.00 | 0.27 |
| 100 | 601872 | 招商轮船 | 109,000 | 609,310.00 | 0.27 |
| 101 | 002268 | 电科网安 | 19,900 | 607,547.00 | 0.27 |
| 102 | 600497 | 驰宏锌锗 | 119,600 | 605,176.00 | 0.27 |
| 103 | 600143 | 金发科技 | 62,400 | 604,656.00 | 0.27 |
| 104 | 002025 | 航天电器 | 9,100 | 602,875.00 | 0.27 |
| 105 | 002532 | 天山铝业 | 78,000 | 602,160.00 | 0.27 |
| 106 | 002299 | 圣农发展 | 25,000 | 592,250.00 | 0.26 |
| 107 | 300253 | 卫宁健康 | 57,600 | 592,128.00 | 0.26 |
| 108 | 601696 | 中银证券 | 55,900 | 590,863.00 | 0.26 |
| 109 | 600177 | 雅戈尔 | 93,200 | 589,956.00 | 0.26 |
| 110 | 601990 | 南京证券 | 74,200 | 588,406.00 | 0.26 |
| 111 | 002439 | 启明星辰 | 22,400 | 584,192.00 | 0.26 |
| 112 | 600705 | 中航产融 | 177,700 | 582,856.00 | 0.26 |
| 113 | 603737 | 三棵树 | 5,100 | 580,533.00 | 0.26 |
| 114 | 002624 | 完美世界 | 45,600 | 580,032.00 | 0.26 |
| 115 | 000591 | 太阳能 | 78,700 | 576,871.00 | 0.25 |
| 116 | 600348 | 华阳股份 | 40,300 | 574,275.00 | 0.25 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 117 | 000998 | 隆平高科 | 35,300 | 567,271.00 | 0.25 |
| 118 | 000738 | 航发控制 | 22,100 | 566,644.00 | 0.25 |
| 119 | 600026 | 中远海能 | 46,600 | 561,530.00 | 0.25 |
| 120 | 600258 | 首旅酒店 | 22,539 | 558,967.20 | 0.25 |
| 121 | 002850 | 科达利 | 4,700 | 558,407.00 | 0.25 |
| 122 | 600549 | 厦门钨业 | 28,500 | 557,175.00 | 0.25 |
| 123 | 000728 | 国元证券 | 87,800 | 555,774.00 | 0.25 |
| 124 | 600482 | 中国动力 | 36,200 | 553,498.00 | 0.24 |
| 125 | 000988 | 华工科技 | 33,700 | 553,017.00 | 0.24 |
| 126 | 000519 | 中兵红箭 | 28,000 | 549,920.00 | 0.24 |
| 127 | 002273 | 水晶光电 | 46,630 | 549,767.70 | 0.24 |
| 128 | 002673 | 西部证券 | 90,000 | 548,100.00 | 0.24 |
| 129 | 300604 | 长川科技 | 12,200 | 543,876.00 | 0.24 |
| 130 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,179 | 539,840.52 | 0.24 |
| 131 | 601997 | 贵阳银行 | 98,100 | 538,569.00 | 0.24 |
| 132 | 300136 | 信维通信 | 32,500 | 536,575.00 | 0.24 |
| 133 | 002507 | 涪陵榨菜 | 20,800 | 536,016.00 | 0.24 |
| 134 | 300832 | 新产业 | 10,500 | 526,470.00 | 0.23 |
| 135 | 300363 | 博腾股份 | 12,800 | 522,880.00 | 0.23 |
| 136 | 002092 | 中泰化学 | 69,800 | 520,708.00 | 0.23 |
| 137 | 002430 | 杭氧股份 | 13,200 | 519,552.00 | 0.23 |
| 138 | 000703 | 恒逸石化 | 73,800 | 518,814.00 | 0.23 |
| 139 | 600325 | 华发股份 | 56,800 | 514,608.00 | 0.23 |
| 140 | 002030 | 达安基因 | 32,940 | 512,546.40 | 0.23 |
| 141 | 002739 | 万达电影 | 36,600 | 512,400.00 | 0.23 |
| 142 | 002056 | 横店东磁 | 27,300 | 511,602.00 | 0.23 |
| 143 | 002557 | 洽洽食品 | 10,200 | 510,000.00 | 0.22 |
| 144 | 300308 | 中际旭创 | 18,800 | 508,164.00 | 0.22 |
| 145 | 600529 | 山东药玻 | 17,800 | 505,520.00 | 0.22 |
| 146 | 601666 | 平煤股份 | 46,600 | 503,746.00 | 0.22 |
| 147 | 600704 | 物产中大 | 104,600 | 503,126.00 | 0.22 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 148 | 603233 | 大参林 | 12,700 | 502,920.00 | 0.22 |
| 149 | 002156 | 通富微电 | 30,500 | 502,640.00 | 0.22 |
| 150 | 601198 | 东兴证券 | 65,100 | 502,572.00 | 0.22 |
| 151 | 000729 | 燕京啤酒 | 47,300 | 502,326.00 | 0.22 |
| 152 | 002465 | 海格通信 | 61,800 | 501,816.00 | 0.22 |
| 153 | 601016 | 节能风电 | 131,110 | 499,529.10 | 0.22 |
| 154 | 600655 | 豫园股份 | 65,400 | 497,694.00 | 0.22 |
| 155 | 600879 | 航天电子 | 73,000 | 496,400.00 | 0.22 |
| 156 | 300088 | 长信科技 | 82,300 | 491,331.00 | 0.22 |
| 157 | 603658 | 安图生物 | 7,900 | 488,615.00 | 0.22 |
| 158 | 002409 | 雅克科技 | 9,600 | 483,552.00 | 0.21 |
| 159 | 600546 | 山煤国际 | 33,300 | 482,517.00 | 0.21 |
| 160 | 002080 | 中材科技 | 22,500 | 482,175.00 | 0.21 |
| 161 | 600415 | 小商品城 | 92,000 | 482,080.00 | 0.21 |
| 162 | 688116 | 天奈科技 | 6,227 | 480,350.78 | 0.21 |
| 163 | 002353 | 杰瑞股份 | 17,200 | 480,052.00 | 0.21 |
| 164 | 000830 | 鲁西化工 | 38,600 | 478,254.00 | 0.21 |
| 165 | 603267 | 鸿远电子 | 4,700 | 475,452.00 | 0.21 |
| 166 | 002683 | 广东宏大 | 17,600 | 474,496.00 | 0.21 |
| 167 | 000960 | 锡业股份 | 33,600 | 473,760.00 | 0.21 |
| 168 | 000878 | 云南铜业 | 40,300 | 473,525.00 | 0.21 |
| 169 | 000400 | 许继电气 | 23,700 | 473,289.00 | 0.21 |
| 170 | 600516 | 方大炭素 | 76,600 | 468,792.00 | 0.21 |
| 171 | 000623 | 吉林敖东 | 31,200 | 467,688.00 | 0.21 |
| 172 | 600170 | 上海建工 | 179,200 | 465,920.00 | 0.21 |
| 173 | 603160 | 汇顶科技 | 9,200 | 461,840.00 | 0.20 |
| 174 | 600038 | 中直股份 | 9,900 | 459,459.00 | 0.20 |
| 175 | 002444 | 巨星科技 | 24,200 | 459,316.00 | 0.20 |
| 176 | 002531 | 天顺风能 | 30,200 | 456,926.00 | 0.20 |
| 177 | 600637 | 东方明珠 | 68,700 | 456,855.00 | 0.20 |
| 178 | 300418 | 昆仑万维 | 31,700 | 456,797.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 179 | 002372 | 伟星新材 | 21,400 | 456,676.00 | 0.20 |
| 180 | 300017 | 网宿科技 | 81,800 | 456,444.00 | 0.20 |
| 181 | 601577 | 长沙银行 | 67,500 | 456,300.00 | 0.20 |
| 182 | 600166 | 福田汽车 | 161,100 | 452,691.00 | 0.20 |
| 183 | 600642 | 申能股份 | 82,400 | 452,376.00 | 0.20 |
| 184 | 300373 | 扬杰科技 | 8,600 | 452,360.00 | 0.20 |
| 185 | 600739 | 辽宁成大 | 35,900 | 451,981.00 | 0.20 |
| 186 | 601456 | 国联证券 | 40,100 | 451,125.00 | 0.20 |
| 187 | 600699 | 均胜电子 | 32,100 | 451,005.00 | 0.20 |
| 188 | 603712 | 七一二 | 12,900 | 450,468.00 | 0.20 |
| 189 | 002326 | 永太科技 | 20,600 | 449,698.00 | 0.20 |
| 190 | 002203 | 海亮股份 | 39,600 | 447,480.00 | 0.20 |
| 191 | 000970 | 中科三环 | 32,620 | 444,936.80 | 0.20 |
| 192 | 688002 | 睿创微纳 | 11,956 | 444,643.64 | 0.20 |
| 193 | 603026 | 胜华新材 | 4,800 | 443,040.00 | 0.20 |
| 194 | 000155 | 川能动力 | 24,800 | 442,432.00 | 0.20 |
| 195 | 002508 | 老板电器 | 15,900 | 441,384.00 | 0.19 |
| 196 | 603127 | 昭衍新药 | 7,540 | 440,411.40 | 0.19 |
| 197 | 600673 | 东阳光 | 50,600 | 439,714.00 | 0.19 |
| 198 | 600380 | 健康元 | 38,800 | 438,052.00 | 0.19 |
| 199 | 603444 | 吉比特 | 1,400 | 437,976.00 | 0.19 |
| 200 | 689009 | 九号公司 | 14,334 | 437,043.66 | 0.19 |
| 201 | 000039 | 中集集团 | 61,800 | 435,072.00 | 0.19 |
| 202 | 600909 | 华安证券 | 94,540 | 433,938.60 | 0.19 |
| 203 | 600056 | 中国医药 | 25,120 | 432,817.60 | 0.19 |
| 204 | 600867 | 通化东宝 | 46,800 | 429,624.00 | 0.19 |
| 205 | 300676 | 华大基因 | 8,300 | 429,027.00 | 0.19 |
| 206 | 600118 | 中国卫星 | 19,800 | 426,690.00 | 0.19 |
| 207 | 000739 | 普洛药业 | 19,800 | 426,492.00 | 0.19 |
| 208 | 600985 | 淮北矿业 | 33,300 | 426,240.00 | 0.19 |
| 209 | 002065 | 东华软件 | 75,300 | 426,198.00 | 0.19 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 210 | 000750 | 国海证券 | 127,800 | 425,574.00 | 0.19 |
| 211 | 300244 | 迪安诊断 | 16,800 | 422,184.00 | 0.19 |
| 212 | 300058 | 蓝色光标 | 83,600 | 422,180.00 | 0.19 |
| 213 | 600369 | 西南证券 | 111,500 | 418,125.00 | 0.18 |
| 214 | 600008 | 首创环保 | 147,700 | 417,991.00 | 0.18 |
| 215 | 688009 | 中国通号 | 86,657 | 415,087.03 | 0.18 |
| 216 | 002152 | 广电运通 | 41,700 | 414,498.00 | 0.18 |
| 217 | 300558 | 贝达药业 | 8,400 | 413,868.00 | 0.18 |
| 218 | 600372 | 中航电子 | 25,900 | 413,623.00 | 0.18 |
| 219 | 002831 | 裕同科技 | 12,500 | 413,375.00 | 0.18 |
| 220 | 300474 | 景嘉微 | 7,550 | 412,003.50 | 0.18 |
| 221 | 600998 | 九州通 | 31,400 | 409,456.00 | 0.18 |
| 222 | 000513 | 丽珠集团 | 12,600 | 409,248.00 | 0.18 |
| 223 | 601880 | 辽港股份 | 252,600 | 409,212.00 | 0.18 |
| 224 | 600435 | 北方导航 | 35,000 | 406,000.00 | 0.18 |
| 225 | 000027 | 深圳能源 | 63,800 | 405,768.00 | 0.18 |
| 226 | 002936 | 郑州银行 | 172,490 | 405,351.50 | 0.18 |
| 227 | 000547 | 航天发展 | 43,000 | 403,770.00 | 0.18 |
| 228 | 000636 | 风华高科 | 27,200 | 403,376.00 | 0.18 |
| 229 | 300866 | 安克创新 | 6,800 | 403,036.00 | 0.18 |
| 230 | 002408 | 齐翔腾达 | 57,240 | 402,969.60 | 0.18 |
| 231 | 300070 | 碧水源 | 85,100 | 402,523.00 | 0.18 |
| 232 | 002131 | 利欧股份 | 226,600 | 401,082.00 | 0.18 |
| 233 | 300026 | 红日药业 | 70,500 | 400,440.00 | 0.18 |
| 234 | 002506 | 协鑫集成 | 137,400 | 399,834.00 | 0.18 |
| 235 | 002212 | 天融信 | 39,800 | 397,602.00 | 0.18 |
| 236 | 002926 | 华西证券 | 52,800 | 397,584.00 | 0.18 |
| 237 | 603883 | 老百姓 | 9,820 | 397,415.40 | 0.18 |
| 238 | 600378 | 昊华科技 | 9,200 | 394,772.00 | 0.17 |
| 239 | 300383 | 光环新网 | 48,200 | 393,312.00 | 0.17 |
| 240 | 002183 | 怡 亚 通 | 61,000 | 392,230.00 | 0.17 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 241 | 300682 | 朗新科技 | 17,800 | 391,244.00 | 0.17 |
| 242 | 603858 | 步长制药 | 18,600 | 390,786.00 | 0.17 |
| 243 | 600820 | 隧道股份 | 73,800 | 388,926.00 | 0.17 |
| 244 | 002572 | 索菲亚 | 21,400 | 388,624.00 | 0.17 |
| 245 | 600271 | 航天信息 | 37,300 | 388,293.00 | 0.17 |
| 246 | 002195 | 二三四五 | 192,000 | 385,920.00 | 0.17 |
| 247 | 603893 | 瑞芯微 | 5,600 | 385,336.00 | 0.17 |
| 248 | 600580 | 卧龙电驱 | 30,900 | 385,014.00 | 0.17 |
| 249 | 002250 | 联化科技 | 24,800 | 384,400.00 | 0.17 |
| 250 | 300296 | 利亚德 | 67,900 | 384,314.00 | 0.17 |
| 251 | 000887 | 中鼎股份 | 26,500 | 383,455.00 | 0.17 |
| 252 | 002500 | 山西证券 | 72,300 | 383,190.00 | 0.17 |
| 253 | 600390 | 五矿资本 | 75,400 | 383,032.00 | 0.17 |
| 254 | 600848 | 上海临港 | 32,100 | 382,632.00 | 0.17 |
| 255 | 600863 | 内蒙华电 | 109,500 | 382,155.00 | 0.17 |
| 256 | 002368 | 太极股份 | 13,565 | 381,583.45 | 0.17 |
| 257 | 603156 | 养元饮品 | 17,022 | 379,079.94 | 0.17 |
| 258 | 600021 | 上海电力 | 37,800 | 378,378.00 | 0.17 |
| 259 | 688779 | 长远锂科 | 25,856 | 377,239.04 | 0.17 |
| 260 | 002958 | 青农商行 | 130,500 | 377,145.00 | 0.17 |
| 261 | 601958 | 金钼股份 | 32,500 | 375,375.00 | 0.17 |
| 262 | 688538 | 和辉光电 | 139,817 | 374,709.56 | 0.17 |
| 263 | 300024 | 机器人 | 41,600 | 373,568.00 | 0.16 |
| 264 | 300001 | 特锐德 | 24,400 | 371,124.00 | 0.16 |
| 265 | 600755 | 厦门国贸 | 51,700 | 369,138.00 | 0.16 |
| 266 | 300009 | 安科生物 | 39,340 | 368,222.40 | 0.16 |
| 267 | 002244 | 滨江集团 | 41,700 | 368,211.00 | 0.16 |
| 268 | 688521 | 芯原股份 | 8,339 | 367,499.73 | 0.16 |
| 269 | 688256 | 寒武纪 | 6,715 | 366,370.40 | 0.16 |
| 270 | 600208 | 新湖中宝 | 144,200 | 366,268.00 | 0.16 |
| 271 | 300776 | 帝尔激光 | 2,900 | 365,400.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 272 | 002155 | 湖南黄金 | 28,200 | 365,190.00 | 0.16 |
| 273 | 600315 | 上海家化 | 11,400 | 363,090.00 | 0.16 |
| 274 | 600316 | 洪都航空 | 14,400 | 362,736.00 | 0.16 |
| 274 | 002511 | 中顺洁柔 | 26,400 | 362,736.00 | 0.16 |
| 276 | 603885 | 吉祥航空 | 22,300 | 360,814.00 | 0.16 |
| 277 | 000997 | 新 大 陆 | 27,700 | 360,377.00 | 0.16 |
| 278 | 601231 | 环旭电子 | 22,200 | 360,306.00 | 0.16 |
| 279 | 000060 | 中金岭南 | 87,800 | 359,980.00 | 0.16 |
| 280 | 000050 | 深天马 A | 41,200 | 356,792.00 | 0.16 |
| 281 | 600060 | 海信视像 | 26,300 | 356,102.00 | 0.16 |
| 282 | 601992 | 金隅集团 | 139,900 | 355,346.00 | 0.16 |
| 283 | 601005 | 重庆钢铁 | 224,900 | 355,342.00 | 0.16 |
| 284 | 600511 | 国药股份 | 12,700 | 354,330.00 | 0.16 |
| 285 | 603927 | 中科软 | 11,920 | 352,951.20 | 0.16 |
| 286 | 300850 | 新强联 | 6,600 | 351,648.00 | 0.16 |
| 287 | 603218 | 日月股份 | 17,200 | 349,160.00 | 0.15 |
| 288 | 601717 | 郑煤机 | 30,900 | 344,844.00 | 0.15 |
| 289 | 300251 | 光线传媒 | 39,400 | 341,204.00 | 0.15 |
| 290 | 600528 | 中铁工业 | 44,700 | 341,061.00 | 0.15 |
| 291 | 600201 | 生物股份 | 37,600 | 338,776.00 | 0.15 |
| 292 | 600801 | 华新水泥 | 22,800 | 337,896.00 | 0.15 |
| 293 | 688185 | 康希诺 | 2,312 | 337,598.24 | 0.15 |
| 294 | 600566 | 济川药业 | 12,400 | 337,528.00 | 0.15 |
| 295 | 002939 | 长城证券 | 40,600 | 336,168.00 | 0.15 |
| 296 | 000021 | 深科技 | 31,400 | 335,666.00 | 0.15 |
| 297 | 300168 | 万达信息 | 39,800 | 335,514.00 | 0.15 |
| 298 | 600066 | 宇通客车 | 44,600 | 334,946.00 | 0.15 |
| 299 | 600171 | 上海贝岭 | 19,100 | 332,913.00 | 0.15 |
| 300 | 000825 | 太钢不锈 | 76,900 | 332,208.00 | 0.15 |
| 301 | 002373 | 千方科技 | 37,100 | 330,932.00 | 0.15 |
| 302 | 600906 | 财达证券 | 43,500 | 329,295.00 | 0.15 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 303 | 600598 | 北大荒 | 23,900 | 328,864.00 | 0.15 |
| 304 | 600839 | 四川长虹 | 123,900 | 327,096.00 | 0.14 |
| 305 | 600827 | 百联股份 | 26,900 | 326,028.00 | 0.14 |
| 306 | 600282 | 南钢股份 | 103,400 | 325,710.00 | 0.14 |
| 307 | 600535 | 天士力 | 30,200 | 324,952.00 | 0.14 |
| 308 | 300677 | 英科医疗 | 15,440 | 324,703.20 | 0.14 |
| 309 | 600970 | 中材国际 | 38,000 | 323,760.00 | 0.14 |
| 310 | 601866 | 中远海发 | 133,000 | 321,860.00 | 0.14 |
| 311 | 601778 | 晶科科技 | 58,300 | 320,650.00 | 0.14 |
| 312 | 601665 | 齐鲁银行 | 76,800 | 320,256.00 | 0.14 |
| 313 | 600500 | 中化国际 | 48,200 | 318,602.00 | 0.14 |
| 314 | 002128 | 电投能源 | 25,800 | 318,372.00 | 0.14 |
| 315 | 601179 | 中国西电 | 68,800 | 317,168.00 | 0.14 |
| 316 | 002127 | 南极电商 | 65,900 | 316,979.00 | 0.14 |
| 317 | 002153 | 石基信息 | 21,080 | 315,989.20 | 0.14 |
| 318 | 603568 | 伟明环保 | 17,040 | 315,751.20 | 0.14 |
| 319 | 688188 | 柏楚电子 | 1,453 | 315,417.24 | 0.14 |
| 320 | 300861 | 美畅股份 | 6,400 | 314,624.00 | 0.14 |
| 321 | 600498 | 烽火通信 | 23,900 | 314,046.00 | 0.14 |
| 322 | 000930 | 中粮科技 | 37,500 | 313,500.00 | 0.14 |
| 323 | 000709 | 河钢股份 | 138,660 | 313,371.60 | 0.14 |
| 324 | 603000 | 人民网 | 18,500 | 312,095.00 | 0.14 |
| 325 | 002595 | 豪迈科技 | 13,400 | 310,210.00 | 0.14 |
| 326 | 000012 | 南 玻Ａ | 46,100 | 309,331.00 | 0.14 |
| 327 | 300182 | 捷成股份 | 69,100 | 308,877.00 | 0.14 |
| 328 | 300888 | 稳健医疗 | 4,300 | 307,450.00 | 0.14 |
| 329 | 600398 | 海澜之家 | 58,000 | 307,400.00 | 0.14 |
| 330 | 002701 | 奥瑞金 | 60,400 | 305,020.00 | 0.13 |
| 331 | 002019 | 亿帆医药 | 24,700 | 302,575.00 | 0.13 |
| 332 | 000987 | 越秀资本 | 50,440 | 302,135.60 | 0.13 |
| 333 | 002124 | 天邦食品 | 49,380 | 301,711.80 | 0.13 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 334 | 002985 | 北摩高科 | 6,678 | 301,177.80 | 0.13 |
| 335 | 002396 | 星网锐捷 | 15,700 | 300,812.00 | 0.13 |
| 336 | 600959 | 江苏有线 | 100,600 | 298,782.00 | 0.13 |
| 337 | 000581 | 威孚高科 | 16,800 | 297,864.00 | 0.13 |
| 338 | 600895 | 张江高科 | 26,000 | 294,840.00 | 0.13 |
| 339 | 000598 | 兴蓉环境 | 60,100 | 293,889.00 | 0.13 |
| 340 | 000401 | 冀东水泥 | 35,700 | 293,811.00 | 0.13 |
| 341 | 603707 | 健友股份 | 16,269 | 293,492.76 | 0.13 |
| 342 | 000778 | 新兴铸管 | 80,300 | 293,095.00 | 0.13 |
| 343 | 300618 | 寒锐钴业 | 7,300 | 292,365.00 | 0.13 |
| 344 | 300115 | 长盈精密 | 28,180 | 291,099.40 | 0.13 |
| 345 | 600582 | 天地科技 | 55,500 | 288,600.00 | 0.13 |
| 346 | 002670 | 国盛金控 | 38,900 | 288,249.00 | 0.13 |
| 347 | 600663 | 陆家嘴 | 29,500 | 287,330.00 | 0.13 |
| 348 | 688208 | 道通科技 | 9,084 | 286,600.20 | 0.13 |
| 349 | 300482 | 万孚生物 | 8,990 | 286,511.30 | 0.13 |
| 350 | 002249 | 大洋电机 | 55,900 | 286,208.00 | 0.13 |
| 351 | 600297 | 广汇汽车 | 136,000 | 285,600.00 | 0.13 |
| 352 | 600718 | 东软集团 | 28,700 | 285,565.00 | 0.13 |
| 353 | 600507 | 方大特钢 | 46,947 | 282,620.94 | 0.12 |
| 354 | 002690 | 美亚光电 | 11,810 | 282,259.00 | 0.12 |
| 355 | 002266 | 浙富控股 | 72,100 | 281,911.00 | 0.12 |
| 356 | 688690 | 纳微科技 | 5,432 | 281,214.64 | 0.12 |
| 357 | 603225 | 新凤鸣 | 25,700 | 279,616.00 | 0.12 |
| 358 | 600329 | 达仁堂 | 9,600 | 279,360.00 | 0.12 |
| 359 | 600517 | 国网英大 | 57,500 | 278,300.00 | 0.12 |
| 360 | 000883 | 湖北能源 | 66,100 | 277,620.00 | 0.12 |
| 361 | 002505 | 鹏都农牧 | 106,900 | 275,802.00 | 0.12 |
| 362 | 603866 | 桃李面包 | 17,848 | 274,859.20 | 0.12 |
| 363 | 600409 | 三友化工 | 41,500 | 274,315.00 | 0.12 |
| 364 | 000656 | 金科股份 | 143,300 | 273,703.00 | 0.12 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 365 | 300212 | 易华录 | 13,400 | 273,494.00 | 0.12 |
| 366 | 600259 | 广晟有色 | 6,800 | 273,360.00 | 0.12 |
| 367 | 601000 | 唐山港 | 99,400 | 272,356.00 | 0.12 |
| 368 | 600022 | 山东钢铁 | 183,600 | 271,728.00 | 0.12 |
| 369 | 002002 | 鸿达兴业 | 83,800 | 271,512.00 | 0.12 |
| 370 | 600871 | 石化油服 | 136,600 | 270,468.00 | 0.12 |
| 371 | 000089 | 深圳机场 | 34,400 | 270,384.00 | 0.12 |
| 372 | 601106 | 中国一重 | 92,000 | 269,560.00 | 0.12 |
| 373 | 600567 | 山鹰国际 | 108,400 | 268,832.00 | 0.12 |
| 374 | 000785 | 居然之家 | 65,700 | 268,713.00 | 0.12 |
| 375 | 600064 | 南京高科 | 40,623 | 268,518.03 | 0.12 |
| 376 | 300376 | 易事特 | 39,000 | 266,370.00 | 0.12 |
| 377 | 688029 | 南微医学 | 3,237 | 265,854.81 | 0.12 |
| 378 | 002468 | 申通快递 | 25,700 | 265,481.00 | 0.12 |
| 379 | 600216 | 浙江医药 | 22,700 | 265,363.00 | 0.12 |
| 380 | 002429 | 兆驰股份 | 75,900 | 264,891.00 | 0.12 |
| 381 | 600782 | 新钢股份 | 64,208 | 262,610.72 | 0.12 |
| 382 | 002081 | 金 螳 螂 | 53,400 | 258,990.00 | 0.11 |
| 383 | 601333 | 广深铁路 | 113,800 | 258,326.00 | 0.11 |
| 384 | 601718 | 际华集团 | 88,400 | 257,244.00 | 0.11 |
| 385 | 600667 | 太极实业 | 49,500 | 255,420.00 | 0.11 |
| 386 | 601187 | 厦门银行 | 44,300 | 253,839.00 | 0.11 |
| 387 | 601118 | 海南橡胶 | 57,400 | 251,412.00 | 0.11 |
| 388 | 002010 | 传化智联 | 47,000 | 250,980.00 | 0.11 |
| 389 | 600062 | 华润双鹤 | 14,000 | 250,460.00 | 0.11 |
| 390 | 002191 | 劲嘉股份 | 34,500 | 249,435.00 | 0.11 |
| 391 | 600728 | 佳都科技 | 47,200 | 249,216.00 | 0.11 |
| 392 | 600737 | 中粮糖业 | 35,900 | 249,146.00 | 0.11 |
| 393 | 300463 | 迈克生物 | 14,400 | 249,120.00 | 0.11 |
| 394 | 600597 | 光明乳业 | 23,100 | 248,556.00 | 0.11 |
| 395 | 000540 | 中天金融 | 164,500 | 248,395.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 396 | 000537 | 广宇发展 | 18,700 | 247,401.00 | 0.11 |
| 397 | 600376 | 首开股份 | 43,303 | 246,394.07 | 0.11 |
| 398 | 600155 | 华创阳安 | 37,900 | 246,350.00 | 0.11 |
| 399 | 601156 | 东航物流 | 16,000 | 244,160.00 | 0.11 |
| 400 | 002745 | 木林森 | 29,900 | 242,489.00 | 0.11 |
| 401 | 002221 | 东华能源 | 31,700 | 241,871.00 | 0.11 |
| 402 | 600131 | 国网信通 | 16,100 | 240,856.00 | 0.11 |
| 403 | 300072 | 海新能科 | 55,200 | 240,672.00 | 0.11 |
| 404 | 601098 | 中南传媒 | 24,100 | 240,518.00 | 0.11 |
| 405 | 600967 | 内蒙一机 | 28,600 | 236,236.00 | 0.10 |
| 406 | 002416 | 爱施德 | 24,900 | 236,052.00 | 0.10 |
| 407 | 600126 | 杭钢股份 | 56,600 | 233,758.00 | 0.10 |
| 408 | 603379 | 三美股份 | 8,200 | 233,372.00 | 0.10 |
| 409 | 000156 | 华数传媒 | 31,100 | 232,939.00 | 0.10 |
| 410 | 601991 | 大唐发电 | 83,200 | 232,128.00 | 0.10 |
| 411 | 603228 | 景旺电子 | 11,400 | 230,736.00 | 0.10 |
| 412 | 002048 | 宁波华翔 | 16,400 | 227,960.00 | 0.10 |
| 413 | 600808 | 马钢股份 | 81,100 | 227,891.00 | 0.10 |
| 414 | 601568 | 北元集团 | 39,960 | 226,573.20 | 0.10 |
| 415 | 000937 | 冀中能源 | 35,600 | 226,416.00 | 0.10 |
| 416 | 002281 | 光迅科技 | 14,100 | 221,652.00 | 0.10 |
| 417 | 002423 | 中粮资本 | 30,900 | 221,244.00 | 0.10 |
| 418 | 600901 | 江苏金租 | 40,100 | 219,748.00 | 0.10 |
| 419 | 001914 | 招商积余 | 14,200 | 218,396.00 | 0.10 |
| 420 | 600373 | 中文传媒 | 22,700 | 217,239.00 | 0.10 |
| 421 | 300630 | 普利制药 | 8,800 | 217,008.00 | 0.10 |
| 422 | 600095 | 湘财股份 | 28,700 | 216,972.00 | 0.10 |
| 423 | 688289 | 圣湘生物 | 9,859 | 216,405.05 | 0.10 |
| 424 | 003035 | 南网能源 | 38,100 | 216,027.00 | 0.10 |
| 425 | 000559 | 万向钱潮 | 44,300 | 215,741.00 | 0.10 |
| 426 | 000898 | 鞍钢股份 | 80,400 | 214,668.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 427 | 603056 | 德邦股份 | 10,300 | 214,549.00 | 0.09 |
| 428 | 002434 | 万里扬 | 26,400 | 212,520.00 | 0.09 |
| 429 | 000402 | 金 融 街 | 40,100 | 210,525.00 | 0.09 |
| 430 | 301029 | 怡合达 | 3,200 | 210,368.00 | 0.09 |
| 431 | 603317 | 天味食品 | 7,620 | 209,397.60 | 0.09 |
| 432 | 002867 | 周大生 | 14,750 | 206,942.50 | 0.09 |
| 433 | 600556 | 天下秀 | 30,300 | 204,222.00 | 0.09 |
| 434 | 601598 | 中国外运 | 52,900 | 203,136.00 | 0.09 |
| 435 | 601608 | 中信重工 | 58,200 | 203,118.00 | 0.09 |
| 436 | 601928 | 凤凰传媒 | 25,600 | 202,752.00 | 0.09 |
| 437 | 601611 | 中国核建 | 26,600 | 202,160.00 | 0.09 |
| 438 | 000563 | 陕国投 A | 66,443 | 201,322.29 | 0.09 |
| 439 | 300257 | 开山股份 | 13,300 | 199,500.00 | 0.09 |
| 440 | 600707 | 彩虹股份 | 48,100 | 199,134.00 | 0.09 |
| 441 | 002948 | 青岛银行 | 59,200 | 198,912.00 | 0.09 |
| 442 | 600195 | 中牧股份 | 17,100 | 198,702.00 | 0.09 |
| 443 | 000959 | 首钢股份 | 52,500 | 197,925.00 | 0.09 |
| 444 | 001203 | 大中矿业 | 15,200 | 196,536.00 | 0.09 |
| 445 | 600968 | 海油发展 | 68,200 | 196,416.00 | 0.09 |
| 446 | 600167 | 联美控股 | 30,700 | 194,024.00 | 0.09 |
| 447 | 000967 | 盈峰环境 | 42,700 | 193,858.00 | 0.09 |
| 448 | 002110 | 三钢闽光 | 41,100 | 193,170.00 | 0.09 |
| 449 | 603650 | 彤程新材 | 6,000 | 184,980.00 | 0.08 |
| 450 | 002705 | 新宝股份 | 11,100 | 184,815.00 | 0.08 |
| 451 | 000415 | 渤海租赁 | 83,000 | 183,430.00 | 0.08 |
| 452 | 688006 | 杭可科技 | 4,143 | 181,339.11 | 0.08 |
| 453 | 000990 | 诚志股份 | 20,406 | 179,572.80 | 0.08 |
| 454 | 300869 | 康泰医学 | 5,400 | 175,878.00 | 0.08 |
| 455 | 002925 | 盈趣科技 | 10,500 | 173,460.00 | 0.08 |
| 456 | 600307 | 酒钢宏兴 | 105,100 | 173,415.00 | 0.08 |
| 457 | 601828 | 美凯龙 | 36,400 | 170,716.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 458 | 002242 | 九阳股份 | 10,300 | 169,744.00 | 0.07 |
| 459 | 688819 | 天能股份 | 4,609 | 169,334.66 | 0.07 |
| 460 | 603638 | 艾迪精密 | 11,300 | 168,596.00 | 0.07 |
| 461 | 600339 | 中油工程 | 56,200 | 167,476.00 | 0.07 |
| 462 | 600764 | 中国海防 | 7,200 | 165,312.00 | 0.07 |
| 463 | 000031 | 大悦城 | 43,100 | 162,056.00 | 0.07 |
| 464 | 002399 | 海普瑞 | 12,600 | 161,910.00 | 0.07 |
| 465 | 002653 | 海思科 | 7,200 | 160,200.00 | 0.07 |
| 466 | 600623 | 华谊集团 | 25,300 | 159,896.00 | 0.07 |
| 467 | 002146 | 荣盛发展 | 72,900 | 158,193.00 | 0.07 |
| 468 | 600928 | 西安银行 | 44,700 | 157,344.00 | 0.07 |
| 469 | 688088 | 虹软科技 | 6,802 | 153,113.02 | 0.07 |
| 470 | 601969 | 海南矿业 | 20,500 | 151,905.00 | 0.07 |
| 471 | 600006 | 东风汽车 | 26,800 | 149,544.00 | 0.07 |
| 472 | 600648 | 外高桥 | 12,500 | 149,375.00 | 0.07 |
| 473 | 603719 | 良品铺子 | 4,000 | 147,480.00 | 0.07 |
| 474 | 600787 | 中储股份 | 29,400 | 146,118.00 | 0.06 |
| 475 | 002563 | 森马服饰 | 27,100 | 142,004.00 | 0.06 |
| 476 | 000961 | 中南建设 | 64,200 | 140,598.00 | 0.06 |
| 477 | 000869 | 张 裕 A | 4,600 | 139,104.00 | 0.06 |
| 478 | 600377 | 宁沪高速 | 16,600 | 136,452.00 | 0.06 |
| 479 | 601869 | 长飞光纤 | 4,100 | 133,783.00 | 0.06 |
| 480 | 000553 | 安道麦A | 14,600 | 132,130.00 | 0.06 |
| 481 | 601298 | 青岛港 | 23,500 | 131,835.00 | 0.06 |
| 482 | 600350 | 山东高速 | 22,700 | 129,163.00 | 0.06 |
| 483 | 000062 | 深圳华强 | 10,500 | 128,205.00 | 0.06 |
| 484 | 601139 | 深圳燃气 | 19,300 | 126,222.00 | 0.06 |
| 485 | 002945 | 华林证券 | 9,100 | 119,938.00 | 0.05 |
| 486 | 001872 | 招商港口 | 7,800 | 112,008.00 | 0.05 |
| 487 | 601228 | 广州港 | 35,400 | 111,510.00 | 0.05 |
| 487 | 600299 | 安迪苏 | 13,500 | 111,510.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 489 | 603355 | 莱克电气 | 3,880 | 108,795.20 | 0.05 |
| 490 | 603868 | 飞科电器 | 1,600 | 107,728.00 | 0.05 |
| 491 | 601158 | 重庆水务 | 19,300 | 99,009.00 | 0.04 |
| 492 | 600956 | 新天绿能 | 10,200 | 98,328.00 | 0.04 |
| 493 | 300741 | 华宝股份 | 4,100 | 96,473.00 | 0.04 |
| 494 | 603786 | 科博达 | 1,400 | 92,162.00 | 0.04 |
| 495 | 600927 | 永安期货 | 5,400 | 87,048.00 | 0.04 |
| 496 | 600917 | 重庆燃气 | 10,500 | 83,580.00 | 0.04 |
| 497 | 600032 | 浙江新能 | 7,000 | 80,430.00 | 0.04 |
| 498 | 001227 | 兰州银行 | 21,000 | 79,170.00 | 0.03 |
| 499 | 688772 | 珠海冠宇 | 3,840 | 71,577.60 | 0.03 |
| 500 | 002901 | 大博医疗 | 2,000 | 68,060.00 | 0.03 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688439 | 振华风光 | 1,419 | 162,986.34 | 0.07 |
| 2 | 688237 | 超卓航科 | 2,402 | 134,319.84 | 0.06 |
| 3 | 688381 | 帝奥微 | 1,821 | 69,161.58 | 0.03 |
| 4 | 001301 | 尚太科技 | 1,164 | 68,722.56 | 0.03 |
| 5 | 688171 | 纬德信息 | 2,821 | 53,570.79 | 0.02 |
| 6 | 688480 | 赛恩斯 | 2,302 | 46,477.38 | 0.02 |
| 7 | 301239 | 普瑞眼科 | 288 | 20,067.84 | 0.01 |
| 8 | 300953 | 震裕科技 | 240 | 19,836.00 | 0.01 |
| 9 | 301269 | 华大九天 | 222 | 19,522.68 | 0.01 |
| 10 | 301327 | 华宝新能 | 97 | 17,166.09 | 0.01 |
| 11 | 301175 | 中科环保 | 2,771 | 16,653.71 | 0.01 |
| 12 | 301301 | 川宁生物 | 1,756 | 13,222.68 | 0.01 |
| 13 | 301297 | 富乐德 | 993 | 12,899.07 | 0.01 |
| 14 | 301195 | 北路智控 | 155 | 11,321.20 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 15 | 301230 | 泓博医药 | 229 | 11,065.28 | 0.00 |
| 16 | 301015 | 百洋医药 | 462 | 11,014.08 | 0.00 |
| 17 | 301330 | 熵基科技 | 322 | 10,081.82 | 0.00 |
| 18 | 301338 | 凯格精机 | 197 | 9,651.03 | 0.00 |
| 19 | 301311 | 昆船智能 | 594 | 9,420.84 | 0.00 |
| 20 | 301273 | 瑞晨环保 | 244 | 9,220.76 | 0.00 |
| 21 | 301363 | 美好医疗 | 239 | 9,046.15 | 0.00 |
| 22 | 300763 | 锦浪科技 | 50 | 9,002.50 | 0.00 |
| 23 | 301396 | 宏景科技 | 280 | 8,932.00 | 0.00 |
| 24 | 301356 | 天振股份 | 203 | 8,795.99 | 0.00 |
| 25 | 301152 | 天力锂能 | 178 | 8,301.92 | 0.00 |
| 26 | 301379 | 天山电子 | 337 | 8,300.31 | 0.00 |
| 27 | 301165 | 锐捷网络 | 259 | 8,186.99 | 0.00 |
| 28 | 301121 | 紫建电子 | 160 | 7,963.20 | 0.00 |
| 29 | 301296 | 新巨丰 | 525 | 7,822.50 | 0.00 |
| 30 | 301139 | 元道通信 | 306 | 7,744.86 | 0.00 |
| 31 | 301377 | 鼎泰高科 | 438 | 7,721.94 | 0.00 |
| 32 | 301277 | 新天地 | 299 | 7,708.22 | 0.00 |
| 33 | 301328 | 维峰电子 | 98 | 7,542.08 | 0.00 |
| 34 | 301132 | 满坤科技 | 308 | 7,539.84 | 0.00 |
| 35 | 301161 | 唯万密封 | 346 | 7,518.58 | 0.00 |
| 36 | 301280 | 珠城科技 | 167 | 7,481.60 | 0.00 |
| 37 | 301389 | 隆扬电子 | 432 | 7,413.12 | 0.00 |
| 38 | 301398 | 星源卓镁 | 255 | 7,379.70 | 0.00 |
| 39 | 301335 | 天元宠物 | 218 | 7,372.76 | 0.00 |
| 40 | 301227 | 森鹰窗业 | 247 | 7,284.03 | 0.00 |
| 41 | 301290 | 东星医疗 | 207 | 7,271.91 | 0.00 |
| 42 | 301048 | 金鹰重工 | 843 | 7,182.36 | 0.00 |
| 43 | 301365 | 矩阵股份 | 284 | 6,779.08 | 0.00 |
| 44 | 301171 | 易点天下 | 378 | 6,698.16 | 0.00 |
| 45 | 301313 | 凡拓数创 | 229 | 6,673.06 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 46 | 301339 | 通行宝 | 421 | 6,563.39 | 0.00 |
| 47 | 301359 | 东南电子 | 328 | 6,527.20 | 0.00 |
| 48 | 301326 | 捷邦科技 | 177 | 6,481.74 | 0.00 |
| 49 | 301197 | 工大科雅 | 315 | 6,325.20 | 0.00 |
| 50 | 300952 | 恒辉安防 | 340 | 6,317.20 | 0.00 |
| 51 | 301368 | 丰立智能 | 337 | 6,241.24 | 0.00 |
| 52 | 301270 | 汉仪股份 | 210 | 5,957.70 | 0.00 |
| 53 | 301282 | 金禄电子 | 227 | 5,731.75 | 0.00 |
| 54 | 301285 | 鸿日达 | 453 | 5,707.80 | 0.00 |
| 55 | 301300 | 远翔新材 | 194 | 5,697.78 | 0.00 |
| 56 | 301231 | 荣信文化 | 275 | 5,604.50 | 0.00 |
| 57 | 301176 | 逸豪新材 | 330 | 5,573.70 | 0.00 |
| 58 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 5,423.00 | 0.00 |
| 59 | 301233 | 盛帮股份 | 158 | 5,419.40 | 0.00 |
| 60 | 301388 | 欣灵电气 | 248 | 5,356.80 | 0.00 |
| 61 | 301265 | 华新环保 | 455 | 5,187.00 | 0.00 |
| 62 | 301316 | 慧博云通 | 359 | 5,140.88 | 0.00 |
| 63 | 301349 | 信德新材 | 49 | 5,072.48 | 0.00 |
| 64 | 301319 | 唯特偶 | 94 | 5,007.38 | 0.00 |
| 65 | 300971 | 博亚精工 | 245 | 4,848.55 | 0.00 |
| 66 | 301318 | 维海德 | 112 | 4,674.88 | 0.00 |
| 67 | 301057 | 汇隆新材 | 218 | 4,388.34 | 0.00 |
| 68 | 301276 | 嘉曼服饰 | 193 | 4,363.73 | 0.00 |
| 69 | 301033 | 迈普医学 | 108 | 3,983.04 | 0.00 |
| 70 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 3,296.64 | 0.00 |
| 71 | 301309 | 万得凯 | 129 | 3,155.34 | 0.00 |
| 72 | 600717 | 天津港 | 80 | 328.00 | 0.00 |
| 73 | 600120 | 浙江东方 | 10 | 35.70 | 0.00 |
| 74 | 600522 | 中天科技 | 1 | 16.15 | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600096 | 云天化 | 1,531,001.94 | 0.53 |
| 2 | 300012 | 华测检测 | 1,485,198.00 | 0.52 |
| 3 | 300769 | 德方纳米 | 1,447,711.00 | 0.50 |
| 4 | 002340 | 格林美 | 1,435,835.00 | 0.50 |
| 5 | 002497 | 雅化集团 | 1,424,974.00 | 0.49 |
| 6 | 002240 | 盛新锂能 | 1,339,129.00 | 0.47 |
| 7 | 300390 | 天华超净 | 1,171,447.00 | 0.41 |
| 8 | 002407 | 多氟多 | 1,165,236.00 | 0.40 |
| 9 | 300073 | 当升科技 | 1,134,930.00 | 0.39 |
| 10 | 600188 | 兖矿能源 | 1,102,459.00 | 0.38 |
| 11 | 688063 | 派能科技 | 1,100,408.26 | 0.38 |
| 12 | 688180 | 君实生物 | 1,082,670.15 | 0.38 |
| 13 | 601058 | 赛轮轮胎 | 1,077,355.14 | 0.37 |
| 14 | 688122 | 西部超导 | 1,057,840.13 | 0.37 |
| 15 | 300003 | 乐普医疗 | 1,036,486.00 | 0.36 |
| 16 | 002756 | 永兴材料 | 1,035,847.00 | 0.36 |
| 17 | 688777 | 中控技术 | 1,021,778.08 | 0.35 |
| 18 | 601108 | 财通证券 | 969,042.00 | 0.34 |
| 19 | 002738 | 中矿资源 | 942,977.00 | 0.33 |
| 20 | 603606 | 东方电缆 | 936,048.00 | 0.33 |

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600256 | 广汇能源 | 2,013,178.00 | 0.70 |
| 2 | 600522 | 中天科技 | 1,904,180.00 | 0.66 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 3 | 601615 | 明阳智能 | 1,860,825.00 | 0.65 |
| 4 | 000733 | 振华科技 | 1,798,939.00 | 0.62 |
| 5 | 002340 | 格林美 | 1,593,851.00 | 0.55 |
| 6 | 600188 | 兖矿能源 | 1,525,692.00 | 0.53 |
| 7 | 002180 | 纳思达 | 1,513,454.00 | 0.53 |
| 8 | 600732 | 爱旭股份 | 1,292,906.00 | 0.45 |
| 9 | 300751 | 迈为股份 | 1,289,185.00 | 0.45 |
| 10 | 601117 | 中国化学 | 1,261,761.00 | 0.44 |
| 11 | 600233 | 圆通速递 | 1,254,653.00 | 0.44 |
| 12 | 000723 | 美锦能源 | 1,248,243.00 | 0.43 |
| 13 | 300769 | 德方纳米 | 1,169,133.00 | 0.41 |
| 14 | 600884 | 杉杉股份 | 1,141,351.00 | 0.40 |
| 15 | 000983 | 山西焦煤 | 1,123,664.00 | 0.39 |
| 16 | 688005 | 容百科技 | 1,119,793.02 | 0.39 |
| 17 | 601689 | 拓普集团 | 1,035,628.00 | 0.36 |
| 18 | 605358 | 立昂微 | 1,010,493.96 | 0.35 |
| 19 | 002240 | 盛新锂能 | 1,000,776.00 | 0.35 |
| 20 | 002013 | 中航机电 | 971,428.00 | 0.34 |

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 119,469,522.76 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 130,739,921.21 |

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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。**

**8.12.2 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。**

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
| --- | --- | --- |
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 5 | 应收申购款 | 33,847.77 |
| 6 | 其他应收款 | 5,767.69 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 39,615.46 |

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600157 | 永泰能源 | 441,099.00 | 0.19 | 转融通证券出借 |
| 2 | 300724 | 捷佳伟创 | 410,472.00 | 0.18 | 转融通证券出借 |
| 3 | 688777 | 中控技术 | 408,735.00 | 0.18 | 转融通证券出借 |
| 4 | 300003 | 乐普医疗 | 390,490.00 | 0.17 | 转融通证券出借 |
| 5 | 688063 | 派能科技 | 378,780.00 | 0.17 | 转融通证券出借 |

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688439 | 振华风光 | 162,986.34 | 0.07 | 科创板新股限售 |
| 2 | 688381 | 帝奥微 | 69,161.58 | 0.03 | 科创板新股限售 |

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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500A | 10,206 | 15,827.33 | 11,089,842.54 | 6.87% | 150,443,934.32 | 93.13% |
| 东财中证500C | 5,287 | 12,719.16 | 7,430,606.70 | 11.05% | 59,815,608.25 | 88.95% |
| 合计 | 14,721 | 15,541.06 | 18,520,449.24 | 8.10% | 210,259,542.57 | 91.90% |

### 9.2 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 | 9,020.07 | 0.01% |
| | 东财中证500C | 63.94 | 0.00% |
| | 合计 | 9,084.01 | 0.00% |

### 9.3 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 | 东财中证500A | 0~10 |
| | 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 |

**9.4 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 | 4.76% | 10,000,458.38 | 4.37% | 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 | 4.77% | 10,000,458.38 | 4.37% | 3年 |

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

## §10 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 | 59,896,104.57 | 36,793,994.75 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 70,301,767.99 | 40,145,709.55 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |

| | | |
|---|---|---|
| 本报告期期末基金份额总额 | 161,533,776.86 | 67,246,214.95 |

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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：报告期内基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：报告期内，不涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金合同生效日起至本报告期末，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。本报告期内应支付审计费24,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股 | 佣金 | 占当期佣 | |

| | 单元数量 | | 票成交总额的比例 | | 金总量的比例 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 东财证券 | 2 | 230,852,162.88 | 100.00% | 223,976.66 | 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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 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 | 证监会规定网站及报刊 | 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 | 证监会规定网站及报刊 | 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 | 证监会规定网站及报刊 | 2022-01-28 |
| 6 | 关于公司自有资金拟申购旗 | 证监会规定网站及报刊 | 2022-01-29 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 下权益类公募基金相关事宜的公告 | | |
| 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 | 证监会规定网站及报刊 | 2022-03-11 |
| 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 | 证监会规定网站及报刊 | 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 | 证监会规定网站及报刊 | 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 | 证监会规定网站及报刊 | 2022-06-17 |
| 13 | 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 | 证监会规定网站 | 2022-07-06 |
| 14 | 西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2022年第二季度报告 | 证监会规定网站 | 2022-07-20 |
| 15 | 西藏东财基金管理有限公司 | 证监会规定网站及报刊 | 2022-08-11 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 关于旗下基金参与相关销售机构认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告 | | |
| 16 | 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 | 证监会规定网站 | 2022-08-30 |
| 17 | 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 | 证监会规定网站 | 2022-09-20 |
| 18 | 西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2022年第三季度报告 | 证监会规定网站 | 2022-10-25 |
| 19 | 西藏东财基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告 | 证监会规定网站及报刊 | 2022-11-03 |
| 20 | 西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与京东肯特瑞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 | 证监会规定网站及报刊 | 2022-12-08 |
| 21 | 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 | 证监会规定网站 | 2022-12-21 |
| 22 | 西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书更新 | 证监会规定网站 | 2022-12-23 |
| 23 | 西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新 | 证监会规定网站 | 2022-12-23 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金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。

### 12.2 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

### 13.3 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**

**二〇二三年三月二十九日**