

---

西藏东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人:西藏东财基金管理有限公司

基金托管人:国信证券股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2024年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至2024年09月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	证券ETF东财
场内简称	证券ETF东财
基金主代码	159692
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年05月05日
报告期末基金份额总额	223,455,969.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 但在因特殊情形导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩

	大。 特殊情形包括但不限于：1、法律法规的限制；2、标的指数成份股流动性严重不足；3、标的指数的成份股长期停牌；4、标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；5、标的指数成份股派发现金股息；6、指数成份股定期或临时调整；7、标的指数编制方法发生变化；8、其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。
业绩比较基准	中证证券公司30指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年07月01日 - 2024年09月30日）
1.本期已实现收益	-2,824,457.48
2.本期利润	54,401,537.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.4032
4.期末基金资产净值	273,826,550.54
5.期末基金份额净值	1.2254

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

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

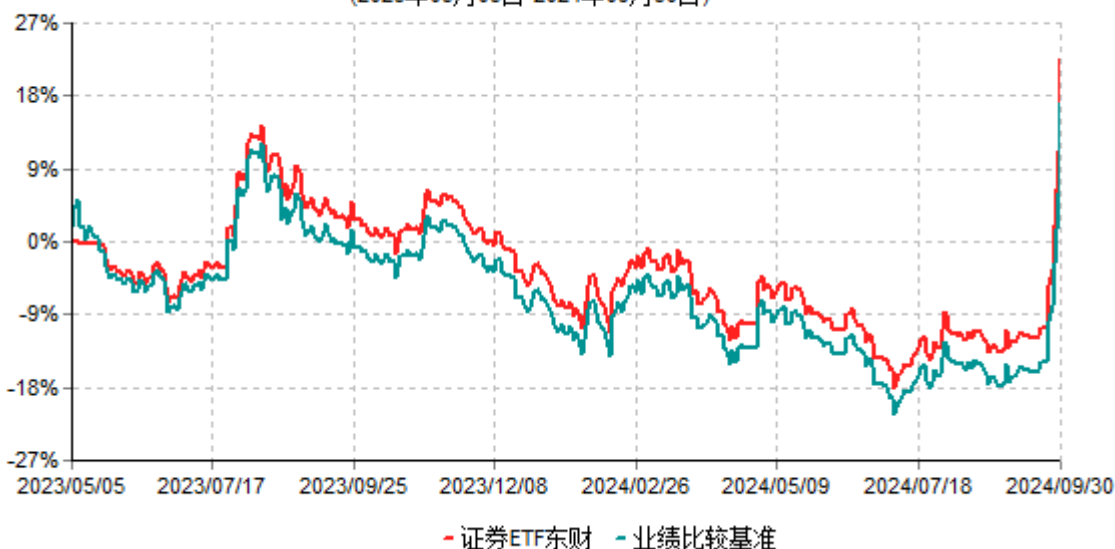
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	42.92%	2.26%	41.83%	2.29%	1.09%	-0.03%
过去六个月	31.82%	1.89%	30.10%	1.91%	1.72%	-0.02%
过去一年	20.07%	1.62%	18.50%	1.64%	1.57%	-0.02%
自基金合同生效起至今	22.54%	1.57%	17.04%	1.62%	5.50%	-0.05%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

证券ETF东财累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年05月05日-2024年09月30日)



注：1、本基金基金合同于2023年5月5日生效。

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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

吴逸	本基金基金经理	2023-05-05	-	14年	上海财经大学金融数学与金融工程硕士。历任天治基金管理有限公司产品创新及量化投资部总监助理、西藏东财基金管理有限公司筹备组量化投资负责人、西藏东财基金管理有限公司研究部总监，现任西藏东财基金管理有限公司总经理助理、基金经理等职务。
莫志刚	本基金基金经理	2023-05-05	2024-07-17	11年	南京大学计算机技术专业硕士。历任万家基金管理有限公司量化研究员、南华基金管理有限公司基金经理，现任西藏东财基金管理有限公司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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

#### 4.1.1 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，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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证证券公司30指数，该指数从沪深两市证券公司中选取业务排名靠前、市值规模大、营业收入高、盈利能力与成长能力相对较强的上市公司证券作为指数样本，以反映证券公司行业相关上市公司证券的整体表现。

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。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2024年09月30日，证券ETF东财份额净值为1.2254元，报告期内基金份额净值增长率为42.92%，同期业绩比较基准收益率为41.83%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	252,364,032.92	91.47
	其中：股票	252,364,032.92	91.47
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	23,547,178.77	8.53
8	其他资产	-	-
9	合计	275,911,211.69	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	252,266,054.77	92.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施	-	-

	管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	252,266,054.77	92.13

### 5.2.2 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	22,890.54	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,603.61	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-



S	综合	-	-
	合计	41,494.15	0.02

### 5.2.3 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300059	东方财富	2,172,500	44,101,750.00	16.11
2	600030	中信证券	1,452,015	39,494,808.00	14.42
3	601688	华泰证券	883,300	15,546,080.00	5.68
4	600999	招商证券	640,500	12,451,320.00	4.55
5	600958	东方证券	903,700	10,040,107.00	3.67
6	000166	申万宏源	1,551,000	8,871,720.00	3.24
7	000776	广发证券	507,400	8,473,580.00	3.09
8	600837	海通证券	964,500	8,458,665.00	3.09
9	601377	兴业证券	1,192,500	8,132,850.00	2.97
10	601901	方正证券	856,100	7,995,974.00	2.92

### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	603381	永臻股份	511	12,338.62	0.00
2	688692	达梦数据	42	12,324.90	0.00
3	688691	灿芯股份	137	6,278.71	0.00
4	688721	龙图光罩	189	5,486.67	0.00
5	603091	众鑫股份	60	2,296.80	0.00

## 5.4 报告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。

## 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### **5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

#### **5.7 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。

#### **5.8 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

#### **5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### **5.9.2 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。

#### **5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **5.10.1 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。

##### **5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### **5.11 投资组合报告附注**

##### **5.11.1 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**

中信证券：2024年5月10日，中国证券监督管理委员会广东监管局对中信证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。2024年4月30日，中国证券监督管理委员会对中信证券股份有限公司处以行政处罚。2024年4月12日，中信证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会的立案告知书。2024年1月5日，中国证券监督管理委员会对中信证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。

华泰证券：2024年4月19日，中国证券监督管理委员会江苏监管局对华泰证券股份有限公司采取责令改正的监管措施。2023年12月15日，中国人民银行江苏省分行对华泰证券股份有限公司处以行政处罚。

招商证券：2024年8月13日，中国证券监督管理委员会深圳监管局对招商证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。2024年4月30日，深圳证券交易所对招商证券股

份有限公司给予通报批评的处分。2024年2月9日，中国证券监督管理委员会深圳监管局对招商证券股份有限公司采取责令改正的监管措施。2024年1月12日，中国证券监督管理委员会安徽监管局对招商证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。

东方证券：2024年7月11日，中国证券监督管理委员会上海监管局对东方证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。2024年2月2日，中国证券监督管理委员会上海监管局对东方证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。

申万宏源：2024年5月6日，中国证券监督管理委员会上海监管局对申万宏源集团股份有限公司采取出具警示函的监管措施。2024年3月19日，中国证券监督管理委员会上海监管局对申万宏源集团股份有限公司采取出具警示函的监管措施。2024年2月5日，中国证券监督管理委员会对申万宏源集团股份有限公司采取责令改正的监管措施。

海通证券：2024年5月8日，上海证券交易所对海通证券股份有限公司给予通报批评的处分。2024年4月30日，中国证券监督管理委员会对海通证券股份有限公司处以行政处罚。2024年4月29日，中国证券监督管理委员会上海监管局对海通证券股份有限公司采取责令改正的监管措施。2024年4月24日，中国证券监督管理委员会广东监管局对海通证券股份有限公司采取责令改正的监管措施。2024年4月12日，海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会的立案告知书。2024年2月1日，中国证券监督管理委员会上海监管局对海通证券股份有限公司采取责令处分有关人员措施。2024年1月22日，中国证券监督管理委员会上海监管局对海通证券股份有限公司采取责令改正的监管措施。2023年11月17日，中国证券监督管理委员会湖北监管局对海通证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。2023年11月7日，中国证券监督管理委员会对海通证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。

兴业证券：2024年8月2日，中国证券监督管理委员会福建监管局对兴业证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。

方正证券：2024年1月3日，中国证券监督管理委员会湖南监管局对方正证券股份有限公司采取责令改正的监管措施。

本基金为指数型基金，采取完全复制策略，跟踪的标的指数为中证证券公司30指数，以上股票为指数成份股。以上股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除此以外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600837	海通证券	8,458,665.00	3.09	停牌

#### 5.11.5.2 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	688692	达梦数据	12,324.90	0.00	新股限售
2	688691	灿芯股份	6,278.71	0.00	新股限售
3	688721	龙图光罩	5,486.67	0.00	新股限售
4	603091	众鑫股份	2,296.80	0.00	新股限售
5	603381	永臻股份	1,203.28	0.00	新股限售

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	139,455,969.00
报告期期间基金总申购份额	116,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	32,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	223,455,969.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
ETF联接基金	1	2024-07-01至2024-09-29	45,798,102.00	3,492,400.00	10,830,900.00	38,459,602.00	17.21%
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险。							

### 8.2 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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

一、中国证监会准予西藏东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件

二、《西藏东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

三、《西藏东财中证证券公司30交易型开放式指数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

### 9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

### 9.3 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  
2024年10月25日