西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金

2025年年度报告

2025年12月31日

基金管理人: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:2026年03月31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2026年03月27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2025年01月01日起至2025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 7
§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 9
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人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 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 审计报告 15
6.1 审计报告基本信息 15
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 20
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 54
8.1 期末基金资产组合情况 54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 55
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 57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 77
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 77
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 77
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 77

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 77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 77
8.12 投资组合报告附注 77
§9 基金份额持有人信息 79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 79
9.2 期末上市基金前十名持有人 79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 80
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 80
§10 开放式基金份额变动 80
§11 重大事件揭示 81
11.1 基金份额持有人大会决议 81
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 81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 81
11.4 基金投资策略的改变 81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 81
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 82
11.8 其他重大事件 82
§12 影响投资者决策的其他重要信息 85
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 85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 86
§13 备查文件目录 86
13.1 备查文件目录 86
13.2 存放地点 86
13.3 查阅方式 86

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证500ETF基金
场内简称	中证500ETF东财
基金主代码	159337
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年09月02日
基金管理人	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	349,710,611.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024年09月20日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
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500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。

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		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	顾勇	刘晴川
	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	北京市朝阳区建国门外大街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	北京市朝阳区建国门外大街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	陈亮

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025年	2024年09月02日（基金合同生效日）-2024年12月31日
本期已实现收益	179,919,070.59	37,206,642.84
本期利润	277,351,332.62	41,619,464.09
加权平均基金份额本期利润	0.3761	0.0883
本期加权平均净值利润率	27.84%	6.97%
本期基金份额净值增长率	32.57%	26.17%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	2024年末
期末可供分配利润	140,340,923.38	64,904,541.28
期末可供分配基金份额利润	0.4013	0.0786
期末基金资产净值	584,910,559.63	1,041,815,135.49
期末基金份额净值	1.6726	1.2617
3.1.3 累计期末指标	2025年末	2024年末
基金份额累计净值增长率	67.26%	26.17%

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

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	1.24%	1.23%	0.72%	1.24%	0.52%	-0.01%
过去六个月	27.10%	1.17%	26.21%	1.17%	0.89%	0.00%
过去一年	32.57%	1.26%	30.39%	1.26%	2.18%	0.00%
自基金合同生效起至今	67.26%	1.56%	64.19%	1.59%	3.07%	-0.03%

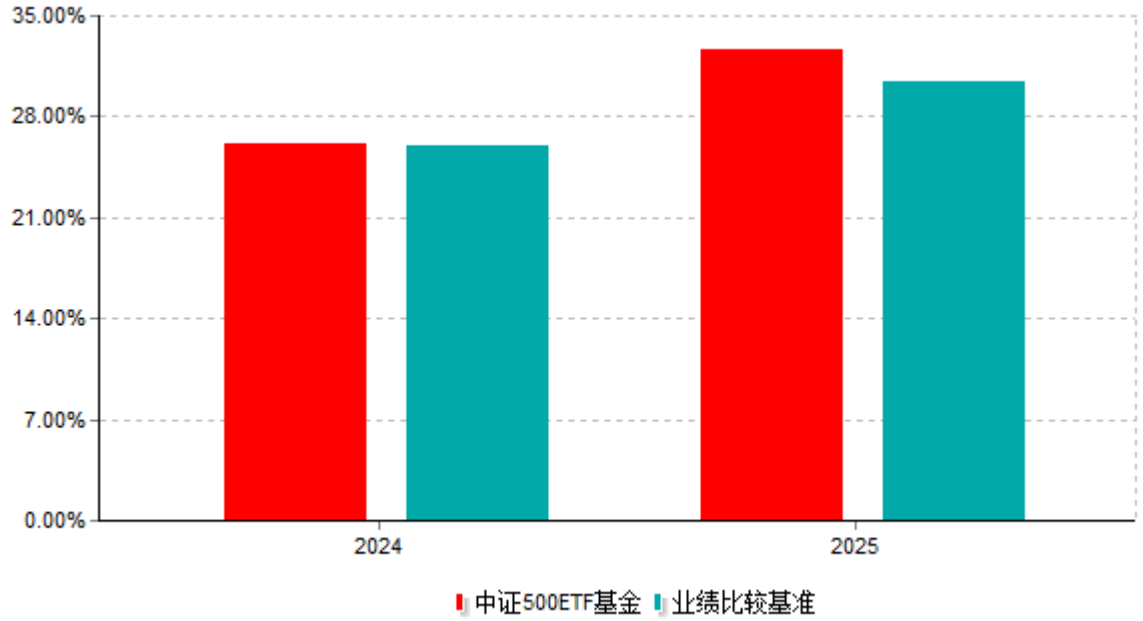
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于2024年9月2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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2024年9月2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

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2025年12月31日，公司旗下管理61只证券投资基金--西藏东财上证50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、西藏东财中证芯片产业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、西藏东财产业优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财时代优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财成长优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财价值启航混合型发起式证券投资基金、西藏东财产业智选混合型发起式证券投资基金、西藏东财远见成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财景气成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、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、西藏东财瑞利债券型证券投资基金、西藏东财中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、西藏东财慧心优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、西藏东财卓越成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财景气驱动混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财北证50成份指数型发起式证券投资基金、西藏东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财上证50交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证1-3年国债交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、西藏东财创业板交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财30天滚动持有债券型发起式证券投资基金、西藏东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金、西藏东财中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金、西藏东财启和混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴逸	本基金基金经理	2024-09-02	-	15.5 年	上海财经大学金融数学与金融工程硕士。曾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、东财基金管理有限公司筹备组量化投资负责人、东财基金管理有限公司研究部总监，现任东财基金管理有限公司总经理助理、量化投资部总监、指数投资部总监、基金经理。
姚楠燕	本基金基金经理助理	2024-09-02	-	8.5年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。曾任中欧国际工商学院金融学/会计学研究助理、东财基金管理有限公司筹备组成员，现任东财基金管理有限公司基金经理兼基金经理助理。

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，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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证500指数，该指数反映沪深市场中小盘市值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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年12月31日，中证500ETF基金份额净值为1.6726元，报告期内基金份额净值增长率为32.57%，同期业绩比较基准收益率为30.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年，中国经济顶压前行、向新向优，全年GDP突破140万亿，按不变价格计算增长5.0%。需求端，消费支撑作用凸显，最终消费支出贡献率达52%，拉动GDP增长2.6个百分点。投资结构持续优化，虽然全国固定资产投资（不含农户）同比下降3.8%，但设备工器具购置投资增长11.8%，高技术服务业投资增长3.5%，有效对冲了整体投资下行压力。净出口稳中提质，货物进出口总额同比增长3.8%，其中高技术产品出口增长13.2%。新质生产力发展方面，科技创新引领产业升级，规模以上高技术制造业增加值增长9.4%，高技术服务业企业营业收入增长7.9%，数字经济、高端装备制造等领域动能强劲。

市场方面，2025年A股呈现慢牛行情，全年成交额创历史新高，最终上证指数、深证成指、创业板指分别累计上涨18.41%、29.87%、49.57%，沪指收官点位创下2007年以来近18年新高。行业板块方面，2025年，申万一级31个行业呈现"涨多跌少"格局，分化特征显著，其中26个行业实现上涨，有色金属、通信、电子行业涨幅居前，分别累计上涨94.73%、84.75%、47.88%；食品饮料、煤炭行业跌幅居前，分别累计下跌9.69%、5.27%，成为全年唯二下跌的行业。

展望2026年，随着中国经济高质量发展持续推进，新质生产力加速壮大，A股盈利基本面将进一步夯实。投资者风险偏好有望延续提升，市场交易活跃度保持高位，行业结构性机会将向高端制造、数字经济、科技创新等核心领域集中。从流动性与估值视角看，2026年A股流动性有望保持合理充裕，内外增量资金持续进场，估值修复空间进一步打开。

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。

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

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 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）、投资组合报告等财务数据真实、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（26）第P00787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交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年度的利润表、净资产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和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交易型开放式指数证券投资基金2025年12月31日的财务状况、2025年度的经营成果和净资产变动情况。
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《中国注册会计师独立性准则第1号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和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交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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	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交易型开放式指数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和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交易型开放式指数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，除非基金管理人的管理层计划清算西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金、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交易型开放式指数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交易型开放式指数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交易型开放式指数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	曾浩、胡本竞
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	2026-03-26

§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交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	6,008,509.86	80,686,335.66
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	580,303,481.54	979,940,145.63
其中：股票投资		580,303,481.54	979,940,145.63
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	-	-
应收清算款		42,774.57	1,458,147.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-

资产总计		586,354,765.97	1,062,084,628.69
负债和净资产	**附注号**	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024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		-	-
应付管理人报酬		243,893.23	391,116.58
应付托管费		24,389.30	39,111.67
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,175,923.81	19,839,264.95
负债合计		1,444,206.34	20,269,493.20
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	349,710,611.00	825,710,611.00
未分配利润	7.4.7.8	235,199,948.63	216,104,524.49
净资产合计		584,910,559.63	1,041,815,135.49
负债和净资产总计		586,354,765.97	1,062,084,628.69

注：报告截止日2025年12月31日，基金份额净值人民币1.6726元，基金份额总额349,710,611.00份。

7.2 利润表

会计主体：西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
一、营业总收入		282,999,504.33	42,741,530.38
1.利息收入		38,020.29	93,900.90
其中：存款利息收入	7.4.7.9	38,020.29	93,900.90
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		184,482,011.41	36,393,802.02
其中：股票投资收益	7.4.7.10	168,121,871.93	35,240,918.21
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	16,360,139.48	1,152,883.81
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	97,432,262.03	4,412,821.25
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	1,047,210.60	1,841,006.21
减：二、营业总支出		5,648,171.71	1,122,066.29
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	4,989,247.11	954,242.09

2.托管费	7.4.10.2.2	498,924.60	95,424.20
3.销售服务费		-	-
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		-	-
8.其他费用	7.4.7.19	160,000.00	72,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		277,351,332.62	41,619,464.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		277,351,332.62	41,619,464.09
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		277,351,332.62	41,619,464.09

注：本基金基金合同生效日为2024年9月2日，上年度实际可比期间为2024年9月2日至2024年12月31日。

7.3 净资产变动表

会计主体：西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	825,710,611.00	216,104,524.49	1,041,815,135.49
二、本期期初净资产	825,710,611.00	216,104,524.49	1,041,815,135.49
三、本期增减变动	-476,000,000.00	19,095,424.14	-456,904,575.86

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	277,351,332.62	277,351,332.62
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-476,000,000.00	-258,255,908.48	-734,255,908.48
其中：1.基金申购款	562,000,000.00	166,874,724.75	728,874,724.75
2.基金赎回款	-1,038,000,000.00	-425,130,633.23	-1,463,130,633.23
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	349,710,611.00	235,199,948.63	584,910,559.63
项 目	**上年度可比期间** **2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	211,710,611.00	-	211,710,611.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	614,000,000.00	216,104,524.49	830,104,524.49
（一）、综合收益总额	-	41,619,464.09	41,619,464.09
（二）、本期基金份额交易产生的净	614,000,000.00	174,485,060.40	788,485,060.40

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	1,062,000,000.00	264,717,204.60	1,326,717,204.60
2.基金赎回款	-448,000,000.00	-90,232,144.20	-538,232,144.20
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	825,710,611.00	216,104,524.49	1,041,815,135.49

注：本基金基金合同生效日为2024年9月2日，上年度实际可比期间为2024年9月2日至2024年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

顾勇	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交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人东财基金管理有限公司（原西藏东财基金管理有限公司，已于2025年9月15日办理完成工商变更登记）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交易型开放式指数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交易型开放式指数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[2024]1015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211,710,611.00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（24）第00145号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2024年9月

2日正式生效。本基金的基金管理人为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《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（非标的指数成份股或其备选成份股，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、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、股票期权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）。本基金的投资组合比例为：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%。本基金可以根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率。

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”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号）和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2025年12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况。

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2024年9月2日（基金合同生效日）至2024年12月31日止。

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

根据本基金的业务特点和风险管理要求，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。申购及赎回等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

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净资产的比例，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。

股利收入于除权除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和托管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（实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配采取现金分红方式；

（3）每一基金份额享有同等分配权；

（4）基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近业绩比较基准同期累计报酬率；

（5）基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后，可在不违反法律法规规定的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

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）根据中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京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），采用第三方估值基准服务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

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无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》、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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延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[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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）对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

（3）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，暂不计缴企业所得税；

（4）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。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

（5）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；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券（股票）交易印花税；

（6）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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	1,000,298.27	1,040,357.65
等于：本金	1,000,072.38	1,040,135.53
加：应计利息	225.89	222.12
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	5,008,211.59	79,645,978.01
等于：本金	5,007,852.42	79,644,375.63
加：应计利息	359.17	1,602.38
减：坏账准备	-	-
合计	6,008,509.86	80,686,335.66

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		478,458,398.26	-	580,303,481.54	101,845,083.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债	交易所市场	-	-	-	-

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		478,458,398.26	-	580,303,481.54	101,845,083.28
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		975,527,324.38	-	979,940,145.63	4,412,821.25
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		975,527,324.38	-	979,940,145.63	4,412,821.25

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

本基金本报告期末及上年度末无其他资产余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
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	40,000.00	32,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	40,000.00
应退替代款	1,015,923.81	10,483,720.15
可退替代款	-	9,283,544.80
合计	1,175,923.81	19,839,264.95

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	825,710,611.00	825,710,611.00
本期申购	562,000,000.00	562,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,038,000,000.00	-1,038,000,000.00
本期末	349,710,611.00	349,710,611.00

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	64,904,541.28	151,199,983.21	216,104,524.49
本期期初	64,904,541.28	151,199,983.21	216,104,524.49

本期利润	179,919,070.59	97,432,262.03	277,351,332.62
本期基金份额交易产生的变动数	-104,482,688.49	-153,773,219.99	-258,255,908.48
其中：基金申购款	61,262,969.64	105,611,755.11	166,874,724.75
基金赎回款	-165,745,658.13	-259,384,975.10	-425,130,633.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	140,340,923.38	94,859,025.25	235,199,948.63

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
活期存款利息收入	7,396.67	39,556.60
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	30,623.62	54,146.01
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	198.29
合计	38,020.29	93,900.90

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	89,676,602.47	20,268,785.78
股票投资收益——赎回差价收入	78,445,269.46	14,972,132.43
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	168,121,871.93	35,240,918.21

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出股票成交总额	1,135,589,187.08	419,074,611.74
减：卖出股票成本总额	1,044,834,508.71	398,212,627.17
减：交易费用	1,078,075.90	593,198.79
买卖股票差价收入	89,676,602.47	20,268,785.78

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	1,463,130,633.23	538,232,144.20
减：现金支付赎回款总额	741,543,809.23	277,520,618.20
减：赎回股票成本总额	643,141,554.54	245,739,393.57
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	78,445,269.46	14,972,132.43

7.4.7.10.4 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 2025年01月01日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	16,360,139.48	1,152,883.81
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	16,360,139.48	1,152,883.81

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
1.交易性金融资产	97,432,262.03	4,412,821.25
——股票投资	97,432,262.03	4,412,821.25
——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	97,432,262.03	4,412,821.25

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
ETF基金替代损益	1,047,210.60	1,841,006.21
合计	1,047,210.60	1,841,006.21

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 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	40,000.00	32,000.00
信息披露费	120,000.00	40,000.00
证券出借违约金	-	-
开户费	-	400.00
合计	160,000.00	72,400.00

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

东财基金管理有限公司	基金管理人
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
西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金

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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东财证券	1,974,807,055.19	100.00%	1,485,418,437.50	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	本期

称	2025年01月01日至2025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	383,046.59	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024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	288,363.75	100.00%	-	-

注：1、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。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,989,247.11	954,242.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	68,911.63	13,009.49
应支付基金管理人的净管理费	4,920,335.48	941,232.60

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 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	498,924.60	95,424.20

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

7.4.10.3 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

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

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

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

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	112,133,371.00	32.06%	177,744,571.00	21.53%
东财证券	118,379,777.00	33.85%	502,000,000.00	60.80%

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

7.4.10.6 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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024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	1,000,298.27	7,396.67	1,040,357.65	39,556.60
东财证券-证券资金户	5,008,211.59	30,623.62	79,645,978.01	54,146.01

注：1、本基金的银行存款存放在托管人中金公司在兴业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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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（2025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
001280	中国铀业	2025-11-25	6个月	新股限售	17.89	45.36	2,231	39,912.59	101,198.16	-
301656	联合动力	2025-09-17	6个月	新股限售	12.48	25.46	3,864	48,222.72	98,377.44	-
688809	强一股份	2025-12-23	6个月	新股限售	85.09	203.31	178	15,146.02	36,189.18	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	6个月	新股限售	114.28	416.18	69	7,885.32	28,716.42	-
688783	西安奕材	2025-10-20	6个月	新股限售	8.62	18.36	1,275	10,990.50	23,409.00	-
688727	恒坤新材	2025-11-11	6个月	新股限售	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
001233	海安集团	2025-11-18	6个月	新股限售	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月	新股限售	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
6888	沐曦	2025-	6个	新股	104.6	399.3	41	4,29	16,37	-

02	股份	12-09	月	限售	6	1		1.06	1.71	
301632	广东建科	2025-08-05	6个月	新股限售	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
688759	必贝特	2025-10-21	6个月	新股限售	17.78	25.11	465	8,267.70	11,676.15	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	新股限售	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
001221	悍高集团	2025-07-23	6个月	新股限售	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
301667	纳百川	2025-12-10	6个月	新股限售	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
688805	健信超导	2025-12-17	6个月	新股限售	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
603418	友升股份	2025-09-16	6个月	新股限售	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6个月	新股限售	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603092	德力佳	2025-10-30	6个月	新股限售	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6个月	新股限售	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	6个月	新股限售	83.06	117.19	65	5,398.90	7,617.35	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6个月	新股限售	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301449	天溯计量	2025-12-16	6个月	新股限售	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301575	艾芬达	2025-09-03	6个月	新股限售	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
603406	天富龙	2025-07-30	6个月	新股限售	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603262	技源集团	2025-07-16	6个月	新股限售	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-

603248	锡华科技	2025-12-16	6个月	新股限售	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	新股限售	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
603370	华新精科	2025-08-27	6个月	新股限售	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6个月	新股限售	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
001396	誉帆科技	2025-12-23	6个月	新股限售	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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、合规审计部、风险管理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2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	6,008,509.86	-	-	-	6,008,509.86
交易性金融资产	-	-	-	580,303,481.54	580,303,481.54
应收清算款	-	-	-	42,774.57	42,774.57
资产总计	6,008,509.86	-	-	580,346,256.11	586,354,765.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	243,893.23	243,893.23
应付托管费	-	-	-	24,389.30	24,389.30
其他负债	-	-	-	1,175,923.81	1,175,923.81
负债总计	-	-	-	1,444,206.34	1,444,206.34
利率敏感度缺口	6,008,509.86	-	-	578,902,049.77	584,910,559.63
上年度末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	80,686,335.66	-	-	-	80,686,335.66
交易性金融资产	-	-	-	979,940,145.63	979,940,145.63
应收清算款	-	-	-	1,458,147.40	1,458,147.40
资产总计	80,686,335.66	-	-	981,398,293.03	1,062,084,628.69

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	391,116.58	391,116.58
应付托管费	-	-	-	39,111.67	39,111.67
其他负债	-	-	-	19,839,264.95	19,839,264.95
负债总计	-	-	-	20,269,493.20	20,269,493.20
利率敏感度缺口	80,686,335.66	-	-	961,128,799.83	1,041,815,135.49

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 2025年12月31日		上年度末 2024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	580,303,481.54	99.21	979,940,145.63	94.06
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	580,303,481.54	99.21	979,940,145.63	94.06

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	28,967,599.16	49,383,994.96
	业绩比较基准下降5%	-28,967,599.16	-49,383,994.96

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	579,789,801.59	979,717,247.22
第二层次	-	27,736.50
第三层次	513,679.95	195,161.91
合计	580,303,481.54	979,940,145.63

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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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 2025年01月01日至2025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	-	195,161.91	195,161.91

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	367,471.02	367,471.02
转出第三层次	-	612,889.10	612,889.10
当期利得或损失总额	-	563,936.12	563,936.12
其中：计入损益的利得或损失	-	563,936.12	563,936.12
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	513,679.95	513,679.95
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	-	274,272.29	274,272.29

项目	上年度可比期间 2024年09月02日（基金合同生效日）至2024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	-	80,226.19	80,226.19
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	114,935.72	114,935.72
其中：计入损益的利得或损失	-	114,935.72	114,935.72
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	195,161.91	195,161.91
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期	-	114,935.72	114,935.72

损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			

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	513,679.95	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1800-3.0791	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	195,161.91	平均价格亚式期权模型	预期波动率	1.6620-4.9648	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2025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（2024年12月31日：同）。

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货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

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	580,303,481.54	98.97
	其中：股票	580,303,481.54	98.97
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	6,008,509.86	1.02
8	其他各项资产	42,774.57	0.01
9	合计	586,354,765.97	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。

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	2,747,606.00	0.47
B	采矿业	24,171,524.80	4.13
C	制造业	394,375,255.16	67.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,706,653.00	2.86
E	建筑业	4,698,940.00	0.80
F	批发和零售业	8,746,056.00	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	8,597,248.00	1.47
H	住宿和餐饮业	705,033.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,505,741.77	8.29

J	金融业	42,674,963.40	7.30
K	房地产业	4,075,174.76	0.70
L	租赁和商务服务业	7,264,874.00	1.24
M	科学研究和技术服务业	3,838,165.14	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	2,520,536.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	832,138.00	0.14
Q	卫生和社会工作	1,794,243.32	0.31
R	文化、体育和娱乐业	4,060,061.00	0.69
S	综合	2,081,504.00	0.36
	合计	578,395,717.35	98.89

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	418,286.76	0.07
C	制造业	1,307,407.34	0.22
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	-	-
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	182,070.09	0.03

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	1,907,764.19	0.33

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	002837	英维克	35,800	3,826,662.00	0.65
2	300136	信维通信	59,700	3,701,400.00	0.63
3	002558	巨人网络	83,400	3,610,386.00	0.62
4	002738	中矿资源	44,300	3,479,765.00	0.59
5	600879	航天电子	162,700	3,468,764.00	0.59
6	600118	中国卫星	36,400	3,456,180.00	0.59
7	300450	先导智能	67,500	3,373,650.00	0.58
8	600580	卧龙电驱	67,360	3,307,376.00	0.57
9	600988	赤峰黄金	102,500	3,202,100.00	0.55
10	000426	兴业银锡	87,500	3,115,000.00	0.53
11	002202	金风科技	148,700	3,033,480.00	0.52
12	600487	亨通光电	121,500	3,004,695.00	0.51
13	601168	西部矿业	102,700	2,838,628.00	0.49

14	002156	通富微电	74,900	2,823,730.00	0.48
15	600549	厦门钨业	68,400	2,808,504.00	0.48
16	002532	天山铝业	171,900	2,781,342.00	0.48
17	300604	长川科技	27,200	2,755,632.00	0.47
18	300115	长盈精密	58,600	2,724,900.00	0.47
19	688347	华虹公司	24,946	2,690,925.02	0.46
20	002353	杰瑞股份	37,900	2,684,457.00	0.46
21	000933	神火股份	96,800	2,659,096.00	0.45
22	002340	格林美	315,100	2,634,236.00	0.45
23	600096	云天化	78,500	2,622,685.00	0.45
24	300395	菲利华	25,900	2,597,770.00	0.44
25	002261	拓维信息	77,700	2,571,870.00	0.44
26	300058	蓝色光标	221,100	2,547,072.00	0.44
27	600143	金发科技	129,800	2,536,292.00	0.43
28	300857	协创数据	14,900	2,513,332.00	0.43
29	301308	江波龙	10,200	2,497,368.00	0.43
30	002195	岩山科技	349,300	2,476,537.00	0.42
31	002851	麦格米特	27,000	2,431,890.00	0.42
32	300339	润和软件	49,000	2,425,500.00	0.41
33	300207	欣旺达	91,100	2,382,265.00	0.41
34	002131	利欧股份	417,100	2,352,444.00	0.40
35	600885	宏发股份	76,400	2,322,560.00	0.40
36	002517	恺英网络	105,300	2,302,911.00	0.39
37	002966	苏州银行	275,300	2,282,237.00	0.39
38	688525	佰维存储	19,828	2,276,056.12	0.39
39	688002	睿创微纳	22,498	2,267,798.40	0.39
40	688120	华海清科	14,958	2,244,896.64	0.38
41	002402	和而泰	57,000	2,229,840.00	0.38
42	601555	东吴证券	244,900	2,218,794.00	0.38
43	002436	兴森科技	104,700	2,216,499.00	0.38
44	300223	北京君正	20,900	2,216,236.00	0.38

45	603228	景旺电子	30,300	2,214,627.00	0.38
46	600601	方正科技	184,100	2,157,652.00	0.37
47	002273	水晶光电	85,600	2,150,272.00	0.37
48	000831	中国稀土	45,600	2,117,664.00	0.36
49	600157	永泰能源	1,343,600	2,109,452.00	0.36
50	300751	迈为股份	10,200	2,101,098.00	0.36
51	002595	豪迈科技	24,800	2,095,848.00	0.36
52	002008	大族激光	50,700	2,088,333.00	0.36
53	600673	东阳光	92,800	2,081,504.00	0.36
54	002281	光迅科技	29,700	2,077,515.00	0.36
55	688122	西部超导	27,818	2,074,666.44	0.35
56	688469	芯联集成	309,807	2,072,608.83	0.35
57	002130	沃尔核材	77,700	2,045,064.00	0.35
58	002472	双环传动	42,000	1,991,220.00	0.34
59	689009	九号公司	35,431	1,969,609.29	0.34
60	002126	银轮股份	52,000	1,965,600.00	0.34
61	688027	国盾量子	3,884	1,956,720.36	0.33
62	300390	天华新能	35,800	1,955,038.00	0.33
63	688235	百济神州	7,240	1,944,664.00	0.33
64	688361	中科飞测	12,618	1,930,427.82	0.33
65	688777	中控技术	39,064	1,927,417.76	0.33
66	002465	海格通信	122,300	1,926,225.00	0.33
67	002128	电投能源	69,000	1,925,790.00	0.33
68	600699	均胜电子	60,300	1,891,008.00	0.32
69	603129	春风动力	6,700	1,867,156.00	0.32
70	600392	盛和资源	86,400	1,860,192.00	0.32
71	002850	科达利	11,700	1,846,962.00	0.32
72	300346	南大光电	42,700	1,831,830.00	0.31
73	301358	湖南裕能	28,000	1,810,480.00	0.31
74	601162	天风证券	434,300	1,806,688.00	0.31
75	603659	璞泰来	65,700	1,796,238.00	0.31

76	688099	晶晨股份	20,516	1,789,610.68	0.31
77	300454	深信服	15,500	1,784,980.00	0.31
78	002797	第一创业	258,800	1,777,956.00	0.30
79	000878	云南铜业	86,400	1,772,064.00	0.30
80	603979	金诚信	23,200	1,766,680.00	0.30
81	002138	顺络电子	49,600	1,762,288.00	0.30
82	601108	财通证券	200,100	1,744,872.00	0.30
83	300054	鼎龙股份	46,400	1,744,640.00	0.30
84	600021	上海电力	86,900	1,739,738.00	0.30
85	002185	华天科技	157,900	1,732,163.00	0.30
86	601099	太平洋	419,900	1,725,789.00	0.30
87	600352	浙江龙盛	160,400	1,709,864.00	0.29
88	002294	信立泰	34,300	1,699,565.00	0.29
89	000021	深科技	67,200	1,698,816.00	0.29
90	000960	锡业股份	60,700	1,692,316.00	0.29
91	688578	艾力斯	16,248	1,692,229.20	0.29
92	688385	复旦微电	22,939	1,690,604.30	0.29
93	300037	新宙邦	32,200	1,687,280.00	0.29
94	688608	恒玄科技	7,398	1,678,902.12	0.29
95	000783	长江证券	204,300	1,665,045.00	0.28
96	601198	东兴证券	119,400	1,657,272.00	0.28
97	300724	捷佳伟创	17,200	1,644,320.00	0.28
98	600141	兴发集团	47,500	1,642,550.00	0.28
99	600298	安琪酵母	37,500	1,640,250.00	0.28
100	000893	亚钾国际	34,100	1,635,777.00	0.28
101	603179	新泉股份	22,100	1,632,748.00	0.28
102	601717	中创智领	66,400	1,630,120.00	0.28
103	002078	太阳纸业	103,300	1,626,975.00	0.28
104	300474	景嘉微	22,600	1,624,262.00	0.28
105	688019	安集科技	7,450	1,623,504.00	0.28
106	601615	明阳智能	111,600	1,615,968.00	0.28

107	600498	烽火通信	50,300	1,613,624.00	0.28
108	688213	思特威	16,965	1,613,201.85	0.28
109	002271	东方雨虹	117,600	1,598,184.00	0.27
110	600536	中国软件	34,500	1,597,350.00	0.27
111	000657	中钨高新	56,200	1,557,302.00	0.27
112	688017	绿的谐波	8,103	1,556,586.30	0.27
113	300017	网宿科技	151,400	1,551,850.00	0.27
114	002414	高德红外	105,200	1,543,284.00	0.26
115	300073	当升科技	26,700	1,543,260.00	0.26
116	300496	中科创达	22,800	1,539,000.00	0.26
117	601696	中银证券	102,600	1,537,974.00	0.26
118	601233	桐昆股份	88,900	1,529,969.00	0.26
119	603606	东方电缆	25,600	1,529,600.00	0.26
120	601665	齐鲁银行	265,400	1,523,396.00	0.26
121	603087	甘李药业	22,200	1,511,154.00	0.26
122	002080	中材科技	41,500	1,508,110.00	0.26
123	688676	金盘科技	16,600	1,499,644.00	0.26
124	600884	杉杉股份	111,000	1,499,610.00	0.26
125	002444	巨星科技	44,000	1,496,880.00	0.26
126	300458	全志科技	35,600	1,496,268.00	0.26
127	600109	国金证券	159,800	1,486,140.00	0.25
128	002157	正邦科技	455,900	1,477,116.00	0.25
129	300757	罗博特科	6,300	1,469,790.00	0.25
130	002085	万丰奥威	91,600	1,466,516.00	0.25
131	688568	中科星图	24,652	1,454,468.00	0.25
132	300748	金力永磁	42,300	1,442,853.00	0.25
133	601577	长沙银行	148,500	1,440,450.00	0.25
134	601128	常熟银行	204,210	1,437,638.40	0.25
135	601179	中国西电	157,900	1,436,890.00	0.25
136	688183	生益电子	14,938	1,429,417.22	0.24
137	002155	湖南黄金	67,320	1,419,778.80	0.24

138	002223	鱼跃医疗	37,100	1,417,591.00	0.24
139	300699	光威复材	35,900	1,416,614.00	0.24
140	600363	联创光电	22,300	1,406,238.00	0.24
141	300024	机器人	77,300	1,406,087.00	0.24
142	300012	华测检测	103,600	1,403,780.00	0.24
143	000559	万向钱潮	81,600	1,403,520.00	0.24
144	300002	神州泰岳	121,200	1,396,224.00	0.24
145	002624	完美世界	83,600	1,370,204.00	0.23
146	300373	扬杰科技	20,100	1,366,800.00	0.23
147	000034	神州数码	35,100	1,365,741.00	0.23
148	600497	驰宏锌锗	186,200	1,361,122.00	0.23
149	603160	汇顶科技	17,200	1,358,800.00	0.23
150	000423	东阿阿胶	27,600	1,354,608.00	0.23
151	000728	国元证券	161,400	1,347,690.00	0.23
152	300285	国瓷材料	49,100	1,345,831.00	0.23
153	002064	华峰化学	122,300	1,345,300.00	0.23
154	002683	广东宏大	28,000	1,338,400.00	0.23
155	300919	中伟股份	28,800	1,334,304.00	0.23
156	603596	伯特利	26,000	1,333,020.00	0.23
157	688599	天合光能	80,495	1,332,192.25	0.23
158	002409	雅克科技	17,600	1,304,160.00	0.22
159	002673	西部证券	165,000	1,301,850.00	0.22
160	600765	中航重机	67,900	1,300,964.00	0.22
161	600079	ST人福	71,600	1,296,676.00	0.22
162	688617	惠泰医疗	5,324	1,295,169.48	0.22
163	603920	世运电路	26,500	1,282,865.00	0.22
164	002410	广联达	101,700	1,279,386.00	0.22
165	002065	东华软件	138,200	1,264,530.00	0.22
166	002756	永兴材料	23,300	1,264,025.00	0.22
167	000733	振华科技	24,000	1,257,840.00	0.22
168	300003	乐普医疗	79,400	1,255,314.00	0.21

169	688220	翱捷科技	15,030	1,241,628.30	0.21
170	002335	科华数据	22,300	1,238,319.00	0.21
171	000997	新 大 陆	43,500	1,231,920.00	0.21
172	600873	梅花生物	120,900	1,224,717.00	0.21
173	002318	久立特材	42,300	1,224,585.00	0.21
174	603766	隆鑫通用	76,000	1,224,360.00	0.21
175	600637	东方明珠	124,300	1,224,355.00	0.21
176	601231	环旭电子	40,800	1,224,000.00	0.21
177	600862	中航高科	51,500	1,216,945.00	0.21
178	000703	恒逸石化	111,100	1,196,547.00	0.20
179	000932	华菱钢铁	212,800	1,195,936.00	0.20
180	000683	博源化工	160,300	1,192,632.00	0.20
181	000528	柳 工	100,100	1,188,187.00	0.20
182	300972	万辰集团	5,900	1,186,313.00	0.20
183	300627	华测导航	33,920	1,184,147.20	0.20
184	605589	圣泉集团	41,800	1,182,940.00	0.20
185	600909	华安证券	172,900	1,172,262.00	0.20
186	600060	海信视像	48,200	1,170,296.00	0.20
187	000750	国海证券	275,300	1,167,272.00	0.20
188	000830	鲁西化工	70,400	1,166,528.00	0.20
189	300001	特锐德	45,400	1,165,872.00	0.20
190	688629	华丰科技	11,643	1,164,998.58	0.20
191	605358	立昂微	33,100	1,152,542.00	0.20
192	000623	吉林敖东	59,000	1,152,270.00	0.20
193	603486	科沃斯	14,200	1,145,656.00	0.20
194	603444	吉比特	2,700	1,144,395.00	0.20
195	000039	中集集团	113,300	1,143,197.00	0.20
196	688052	纳芯微	7,200	1,138,896.00	0.19
197	688234	天岳先进	12,766	1,134,642.08	0.19
198	600737	中粮糖业	65,800	1,132,418.00	0.19
199	002821	凯莱英	12,180	1,131,887.40	0.19

200	000887	中鼎股份	48,600	1,128,006.00	0.19
201	688180	君实生物	33,000	1,127,280.00	0.19
202	000400	许继电气	43,800	1,126,098.00	0.19
203	300570	太辰光	9,700	1,120,835.00	0.19
204	000060	中金岭南	191,500	1,120,275.00	0.19
205	600332	白云山	43,100	1,109,394.00	0.19
206	300383	光环新网	88,600	1,108,386.00	0.19
207	600369	西南证券	245,600	1,100,288.00	0.19
208	688065	凯赛生物	22,034	1,097,293.20	0.19
209	688702	盛科通信	7,740	1,096,680.60	0.19
210	000009	中国宝安	111,300	1,096,305.00	0.19
211	600521	华海药业	64,500	1,094,565.00	0.19
212	300567	精测电子	12,000	1,094,400.00	0.19
213	300677	英科医疗	28,100	1,093,090.00	0.19
214	600171	上海贝岭	34,900	1,090,625.00	0.19
215	688387	信科移动	84,180	1,085,922.00	0.19
216	688266	泽璟制药	11,700	1,084,590.00	0.19
217	600177	雅戈尔	142,400	1,082,240.00	0.19
218	688322	奥比中光	12,064	1,081,778.88	0.18
219	601990	南京证券	136,200	1,078,704.00	0.18
220	688018	乐鑫科技	6,332	1,076,440.00	0.18
221	300142	沃森生物	98,400	1,073,544.00	0.18
222	002203	海亮股份	84,700	1,072,302.00	0.18
223	001696	宗申动力	49,300	1,069,317.00	0.18
224	603568	伟明环保	42,100	1,068,498.00	0.18
225	601212	白银有色	182,300	1,066,455.00	0.18
226	600704	物产中大	191,100	1,064,427.00	0.18
227	601799	星宇股份	8,600	1,060,982.00	0.18
228	601997	贵阳银行	180,300	1,058,361.00	0.18
229	002152	广电运通	76,600	1,057,846.00	0.18
230	300432	富临精工	63,100	1,053,770.00	0.18

231	688375	国博电子	11,290	1,051,211.90	0.18
232	300763	锦浪科技	14,700	1,049,727.00	0.18
233	600486	扬农化工	14,930	1,035,992.70	0.18
234	002429	兆驰股份	139,400	1,034,348.00	0.18
235	000738	航发控制	48,500	1,033,535.00	0.18
236	002739	万达电影	91,100	1,031,252.00	0.18
237	002841	视源股份	25,900	1,026,417.00	0.18
238	002007	华兰生物	67,500	1,021,275.00	0.17
239	002044	美年健康	192,900	1,018,512.00	0.17
240	600801	华新建材	41,500	1,018,410.00	0.17
241	600208	衢州发展	262,100	1,014,327.00	0.17
242	600378	昊华科技	31,700	1,013,132.00	0.17
243	002939	长城证券	99,300	1,012,860.00	0.17
244	688615	合合信息	4,420	1,005,903.60	0.17
245	600435	北方导航	65,100	1,003,842.00	0.17
246	601216	君正集团	207,900	1,002,078.00	0.17
247	601611	中国核建	74,300	1,001,564.00	0.17
248	603605	珀莱雅	14,600	999,808.00	0.17
249	603345	安井食品	12,600	998,928.00	0.17
250	603699	纽威股份	19,100	992,627.00	0.17
251	601567	三星医疗	43,100	992,162.00	0.17
252	600153	建发股份	107,200	991,600.00	0.17
253	600516	方大炭素	173,600	987,784.00	0.17
254	688188	柏楚电子	7,259	986,425.51	0.17
255	600499	科达制造	70,900	983,383.00	0.17
256	002056	横店东磁	50,100	976,950.00	0.17
257	000729	燕京啤酒	86,800	974,764.00	0.17
258	300487	蓝晓科技	15,600	963,300.00	0.16
259	600642	申能股份	120,600	938,268.00	0.16
260	000519	中兵红箭	51,500	937,815.00	0.16
261	688778	厦钨新能	12,093	935,635.41	0.16

262	688692	达梦数据	3,575	934,040.25	0.16
263	601958	金钼股份	59,800	931,684.00	0.16
264	603816	顾家家居	30,300	931,422.00	0.16
265	000155	川能动力	79,500	926,175.00	0.16
266	603728	鸣志电器	12,800	926,080.00	0.16
267	000415	渤海租赁	228,600	925,830.00	0.16
268	600316	洪都航空	26,400	921,624.00	0.16
269	600348	华阳股份	111,200	918,512.00	0.16
270	600038	中直股份	25,400	917,702.00	0.16
271	603379	三美股份	15,000	910,800.00	0.16
272	688114	华大智造	14,980	910,184.80	0.16
273	301611	珂玛科技	10,600	908,738.00	0.16
274	002262	恩华药业	37,600	907,288.00	0.16
275	688538	和辉光电	340,228	905,006.48	0.15
276	688772	珠海冠宇	41,921	902,559.13	0.15
277	600863	内蒙华电	200,900	900,032.00	0.15
278	002926	华西证券	96,900	899,232.00	0.15
279	002430	杭氧股份	30,100	899,087.00	0.15
280	603806	福斯特	64,200	896,232.00	0.15
281	600398	海澜之家	147,800	894,190.00	0.15
282	600563	法拉电子	8,500	892,075.00	0.15
283	000723	美锦能源	189,800	892,060.00	0.15
284	603156	养元饮品	31,000	891,250.00	0.15
285	300679	电连技术	18,300	890,844.00	0.15
286	000629	钒钛股份	286,000	886,600.00	0.15
287	603338	浙江鼎力	15,600	883,584.00	0.15
288	600967	内蒙一机	52,400	880,320.00	0.15
289	600820	隧道股份	135,500	879,395.00	0.15
290	688166	博瑞医药	17,901	878,223.06	0.15
291	002603	以岭药业	51,400	877,398.00	0.15
292	600901	江苏金租	142,800	873,936.00	0.15

293	601699	潞安环能	73,800	870,840.00	0.15
294	600170	上海建工	328,400	870,260.00	0.15
295	600312	平高电气	50,100	869,235.00	0.15
296	600562	国睿科技	30,500	861,930.00	0.15
297	603077	和邦生物	380,700	860,382.00	0.15
298	688278	特宝生物	10,240	856,883.20	0.15
299	603298	杭叉集团	32,200	855,554.00	0.15
300	600166	福田汽车	292,500	854,100.00	0.15
301	601399	国机重装	177,800	849,884.00	0.15
302	001389	广合科技	10,400	848,952.00	0.15
303	002958	青农商行	273,700	848,470.00	0.15
304	002385	大北农	211,900	847,600.00	0.14
305	603737	三棵树	18,240	843,964.80	0.14
306	601106	中国一重	211,200	842,688.00	0.14
307	002025	航天电器	16,800	842,184.00	0.14
308	300100	双林股份	21,200	839,944.00	0.14
309	600970	中材国际	80,600	837,434.00	0.14
310	300623	捷捷微电	30,700	834,119.00	0.14
311	002607	中公教育	303,700	832,138.00	0.14
312	000050	深天马 A	90,900	820,827.00	0.14
313	300676	华大基因	18,000	816,480.00	0.14
314	600008	首创环保	271,200	813,600.00	0.14
315	603939	益丰药房	37,400	812,328.00	0.14
316	002984	森麒麟	38,300	810,811.00	0.14
317	688301	奕瑞科技	8,012	810,093.32	0.14
318	002432	九安医疗	20,100	804,804.00	0.14
319	003031	中瓷电子	11,000	804,760.00	0.14
320	600329	达仁堂	17,600	802,912.00	0.14
321	603885	吉祥航空	53,800	800,544.00	0.14
322	601991	大唐发电	229,100	799,559.00	0.14
323	600282	南钢股份	151,800	798,468.00	0.14

324	600998	九州通	155,300	795,136.00	0.14
325	002500	山西证券	132,600	794,274.00	0.14
326	300144	宋城演艺	96,900	793,611.00	0.14
327	688582	芯动联科	11,996	793,055.56	0.14
328	600380	健康元	67,600	780,780.00	0.13
329	688297	中无人机	16,248	780,228.96	0.13
330	600095	湘财股份	70,500	779,730.00	0.13
331	601155	新城控股	55,800	778,410.00	0.13
332	600132	重庆啤酒	14,900	778,376.00	0.13
333	603589	口子窖	25,900	778,295.00	0.13
334	600763	通策医疗	19,292	775,731.32	0.13
335	000513	丽珠集团	22,400	771,904.00	0.13
336	002244	滨江集团	76,800	771,840.00	0.13
337	600390	五矿资本	138,500	768,675.00	0.13
338	002312	川发龙蟒	69,800	762,914.00	0.13
339	002583	海能达	67,200	760,704.00	0.13
340	000987	越秀资本	92,800	755,392.00	0.13
341	000591	太阳能	168,900	749,916.00	0.13
342	300146	汤臣倍健	62,400	749,424.00	0.13
343	600583	海油工程	136,100	747,189.00	0.13
344	003021	兆威机电	6,000	745,080.00	0.13
345	600995	南网储能	59,200	744,144.00	0.13
346	600602	云赛智联	39,800	743,862.00	0.13
347	601608	中信重工	112,700	742,693.00	0.13
348	600985	淮北矿业	66,300	736,593.00	0.13
349	601865	福莱特	46,700	731,789.00	0.13
350	603225	新凤鸣	37,600	731,696.00	0.13
351	601880	辽港股份	453,700	725,920.00	0.12
352	300558	贝达药业	15,500	723,695.00	0.12
353	600685	中船防务	25,400	722,630.00	0.12
354	601156	东航物流	39,200	721,672.00	0.12

355	600977	中国电影	45,900	721,548.00	0.12
356	603290	斯达半导	7,500	720,675.00	0.12
357	601666	平煤股份	91,300	718,531.00	0.12
358	688728	格科微	47,948	716,343.12	0.12
359	600754	锦江酒店	27,900	705,033.00	0.12
360	000921	海信家电	28,400	704,604.00	0.12
361	300735	光弘科技	28,300	703,538.00	0.12
362	002568	百润股份	32,200	702,282.00	0.12
363	601016	节能风电	237,900	701,805.00	0.12
364	601000	唐山港	182,300	700,032.00	0.12
365	600535	天士力	45,900	691,713.00	0.12
366	600848	上海临港	59,100	691,470.00	0.12
367	600004	白云机场	72,900	689,634.00	0.12
368	000825	太钢不锈	140,400	686,556.00	0.12
369	600816	建元信托	242,500	686,275.00	0.12
370	603927	中科软	35,800	683,422.00	0.12
371	002773	康弘药业	22,800	683,316.00	0.12
372	000032	深桑达Ａ	35,100	679,185.00	0.12
373	600126	杭钢股份	83,100	678,096.00	0.12
374	601001	晋控煤业	51,500	677,225.00	0.12
375	600511	国药股份	23,300	669,875.00	0.11
376	002266	浙富控股	160,800	668,928.00	0.11
377	603650	彤程新材	15,100	666,514.00	0.11
378	002423	中粮资本	56,800	664,560.00	0.11
379	000598	兴蓉环境	92,000	659,640.00	0.11
380	600598	北大荒	43,700	653,315.00	0.11
381	601966	玲珑轮胎	44,900	652,397.00	0.11
382	000563	陕国投Ａ	189,000	652,050.00	0.11
383	002831	裕同科技	22,800	650,028.00	0.11
384	600483	福能股份	68,500	648,695.00	0.11
385	603000	人民网	34,000	647,700.00	0.11

386	000958	电投产融	99,400	643,118.00	0.11
387	300718	长盛轴承	7,500	640,200.00	0.11
388	688318	财富趋势	4,835	639,767.20	0.11
389	600517	国网英大	105,700	635,257.00	0.11
390	000062	深圳华强	25,800	635,196.00	0.11
391	601333	广深铁路	208,900	635,056.00	0.11
392	688281	华秦科技	8,605	635,049.00	0.11
393	002299	圣农发展	38,300	633,482.00	0.11
394	600739	辽宁成大	56,600	632,788.00	0.11
395	601918	新集能源	95,600	631,916.00	0.11
396	600578	京能电力	123,700	630,870.00	0.11
397	002439	启明星辰	44,600	629,752.00	0.11
398	600808	马钢股份	147,100	620,762.00	0.11
399	601118	海南橡胶	105,500	617,175.00	0.11
400	301536	星宸科技	10,300	617,073.00	0.11
401	603899	晨光股份	22,800	616,968.00	0.11
402	600655	豫园股份	119,800	614,574.00	0.11
403	600546	山煤国际	60,900	614,481.00	0.11
404	000951	中国重汽	36,200	611,780.00	0.10
405	300601	康泰生物	41,400	611,478.00	0.10
406	603688	石英股份	16,700	610,886.00	0.10
407	603341	龙旗科技	14,400	608,544.00	0.10
408	601866	中远海发	240,200	605,304.00	0.10
409	002670	国盛证券	35,800	602,872.00	0.10
410	002120	韵达股份	89,300	601,882.00	0.10
411	600566	济川药业	22,800	599,640.00	0.10
412	600131	国网信通	36,900	595,566.00	0.10
413	600582	天地科技	101,900	594,077.00	0.10
414	603786	科博达	7,600	593,560.00	0.10
415	000883	湖北能源	130,700	593,378.00	0.10
416	000709	河钢股份	254,600	588,126.00	0.10

417	688561	奇安信	16,504	587,212.32	0.10
418	603833	欧派家居	11,200	583,408.00	0.10
419	000739	普洛药业	35,700	580,839.00	0.10
420	300529	健帆生物	29,400	578,298.00	0.10
421	601598	中国外运	95,300	577,518.00	0.10
422	600663	陆家嘴	72,736	575,341.76	0.10
423	600707	彩虹股份	88,400	573,716.00	0.10
424	000027	深圳能源	87,900	573,108.00	0.10
425	000967	盈峰环境	77,900	571,786.00	0.10
426	000088	盐 田 港	128,200	570,490.00	0.10
427	002508	老板电器	29,000	561,150.00	0.10
428	600528	中铁工业	68,400	559,512.00	0.10
429	688709	成都华微	12,063	554,777.37	0.09
430	000582	北部湾港	58,500	548,730.00	0.09
431	002153	石基信息	50,400	545,832.00	0.09
432	300888	稳健医疗	14,300	541,112.00	0.09
433	600871	石化油服	250,400	540,864.00	0.09
434	600906	财达证券	79,800	532,266.00	0.09
435	600959	江苏有线	154,000	529,760.00	0.09
436	688363	华熙生物	12,125	529,620.00	0.09
437	300070	碧水源	133,800	524,496.00	0.09
438	603565	中谷物流	51,700	519,068.00	0.09
439	300957	贝泰妮	13,000	514,930.00	0.09
440	002265	建设工业	19,100	512,262.00	0.09
441	603858	步长制药	32,400	506,736.00	0.09
442	688192	迪哲医药	8,736	503,193.60	0.09
443	688425	铁建重工	98,496	499,374.72	0.09
444	688172	燕东微	17,240	498,925.60	0.09
445	601098	中南传媒	44,100	496,566.00	0.08
446	688563	航材股份	8,495	496,532.75	0.08
447	603233	大参林	27,900	491,598.00	0.08

448	003022	联泓新科	24,800	491,288.00	0.08
449	301498	乖宝宠物	7,500	488,625.00	0.08
450	600968	海油发展	125,300	481,152.00	0.08
451	600764	中国海防	17,500	478,450.00	0.08
452	601061	中信金属	33,200	478,080.00	0.08
453	688248	南网科技	10,661	476,973.14	0.08
454	603529	爱玛科技	16,000	475,200.00	0.08
455	301200	大族数控	4,000	475,080.00	0.08
456	601928	凤凰传媒	46,900	470,876.00	0.08
457	600062	华润双鹤	25,700	470,053.00	0.08
458	000959	首钢股份	95,600	468,440.00	0.08
459	688336	三生国健	7,789	463,990.73	0.08
460	600295	鄂尔多斯	36,500	451,140.00	0.08
461	000785	居然智家	153,400	447,928.00	0.08
462	600606	绿地控股	259,700	431,102.00	0.07
463	001286	陕西能源	46,100	429,191.00	0.07
464	002032	苏 泊 尔	9,700	427,576.00	0.07
465	600098	广州发展	64,700	423,138.00	0.07
466	301301	川宁生物	41,300	418,782.00	0.07
467	000537	中绿电	50,900	417,889.00	0.07
468	601965	中国汽研	24,800	411,680.00	0.07
469	002372	伟星新材	39,300	409,899.00	0.07
470	600720	中交设计	56,600	408,652.00	0.07
471	000429	粤高速 A	32,100	378,138.00	0.06
472	600688	上海石化	135,400	376,412.00	0.06
473	688349	三一重能	14,866	375,812.48	0.06
474	688295	中复神鹰	11,365	372,885.65	0.06
475	000898	鞍钢股份	147,000	371,910.00	0.06
476	603658	安图生物	10,400	368,368.00	0.06
477	688520	神州细胞	8,436	365,363.16	0.06
478	688100	威胜信息	9,282	364,782.60	0.06

479	601139	深圳燃气	53,200	351,120.00	0.06
480	000937	冀中能源	65,200	350,776.00	0.06
481	600339	中油工程	103,100	345,385.00	0.06
482	002608	江苏国信	46,400	342,896.00	0.06
483	601019	山东出版	38,600	333,504.00	0.06
484	600032	浙江新能	44,300	328,263.00	0.06
485	003035	南网能源	70,000	320,600.00	0.05
486	603049	中策橡胶	5,500	307,725.00	0.05
487	601228	广州港	93,000	301,320.00	0.05
488	688475	萤石网络	9,911	298,420.21	0.05
489	600927	永安期货	17,900	287,653.00	0.05
490	688819	天能股份	8,564	284,496.08	0.05
491	603707	健友股份	29,800	269,094.00	0.05
492	300140	节能环境	38,200	258,614.00	0.04
493	002945	华林证券	16,600	254,478.00	0.04
494	002461	珠江啤酒	27,100	251,759.00	0.04
495	600007	中国国贸	12,300	243,786.00	0.04
496	000539	粤电力 A	54,900	242,658.00	0.04
497	600299	安迪苏	24,900	223,353.00	0.04
498	001213	中铁特货	54,800	221,940.00	0.04
499	601921	浙版传媒	27,200	212,704.00	0.04
500	001221	悍高集团	2,294	132,690.34	0.02

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	300476	胜宏科技	2,802	805,799.16	0.14
2	001280	中国铀业	7,436	418,286.76	0.07
3	301632	广东建科	6,557	158,220.26	0.03

4	301656	联合动力	3,864	98,377.44	0.02
5	001233	海安集团	1,233	70,682.18	0.01
6	688809	强一股份	178	36,189.18	0.01
7	688795	摩尔线程	69	28,716.42	0.00
8	301678	新恒汇	382	24,532.04	0.00
9	688783	西安奕材	1,275	23,409.00	0.00
10	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
11	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
12	688802	沐曦股份	41	16,371.71	0.00
13	688757	胜科纳米	536	14,102.16	0.00
14	301590	优优绿能	73	12,942.90	0.00
15	688759	必贝特	465	11,676.15	0.00
16	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
17	603072	天和磁材	226	9,195.94	0.00
18	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
19	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
20	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
21	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
22	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
23	603014	威高血净	205	8,124.15	0.00
24	301173	毓恬冠佳	173	7,785.00	0.00
25	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
26	688790	昂瑞微	65	7,617.35	0.00
27	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
28	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
29	301560	众捷汽车	190	6,471.40	0.00
30	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
31	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
32	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
33	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
34	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00

35	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
36	603400	华之杰	57	2,980.53	0.00
37	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
38	001396	誉帆科技	69	2,441.91	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	688578	艾力斯	10,200,129.62	0.98
2	688213	思特威	9,254,145.50	0.89
3	688120	华海清科	9,078,584.35	0.87
4	688220	翱捷科技	8,490,667.65	0.81
5	688361	中科飞测	8,010,503.20	0.77
6	688582	芯动联科	7,905,196.84	0.76
7	688114	华大智造	7,116,413.45	0.68
8	688099	晶晨股份	6,856,895.46	0.66
9	688608	恒玄科技	6,559,234.62	0.63
10	688525	佰维存储	6,538,187.68	0.63
11	688521	芯原股份	6,518,422.34	0.63
12	688235	百济神州	6,425,138.66	0.62
13	688183	生益电子	6,245,768.36	0.60
14	603893	瑞芯微	6,001,627.00	0.58
15	688297	中无人机	5,559,103.05	0.53
16	688002	睿创微纳	5,536,992.66	0.53
17	000933	神火股份	5,029,149.00	0.48
18	002851	麦格米特	4,971,906.00	0.48
19	600363	联创光电	4,870,539.82	0.47
20	002130	沃尔核材	4,790,793.00	0.46

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	688521	芯原股份	14,641,376.42	1.41
2	600418	江淮汽车	14,552,995.00	1.40
3	688578	艾力斯	12,961,732.70	1.24
4	688213	思特威	12,563,146.96	1.21
5	603893	瑞芯微	12,394,733.00	1.19
6	300476	胜宏科技	12,173,611.54	1.17
7	688220	翱捷科技	10,754,961.89	1.03
8	688120	华海清科	10,654,857.26	1.02
9	002625	光启技术	10,151,657.00	0.97
10	688099	晶晨股份	9,914,174.66	0.95
11	600839	四川长虹	9,283,079.00	0.89
12	688361	中科飞测	9,123,045.03	0.88
13	688525	佰维存储	8,784,086.30	0.84
14	688114	华大智造	8,691,261.82	0.83
15	600988	赤峰黄金	8,188,308.00	0.79
16	688002	睿创微纳	8,159,206.50	0.78
17	002384	东山精密	7,648,292.50	0.73
18	688582	芯动联科	7,235,320.46	0.69
19	689009	九号公司	6,955,709.12	0.67
20	601555	东吴证券	6,936,908.50	0.67

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	841,967,168.73
卖出股票收入（成交）总额	1,135,589,187.08

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

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

赤峰黄金：2025年3月21日，中国证券监督管理委员会内蒙古监管局对赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司采取出具警示函的监管措施。

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500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。

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	42,774.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,774.57

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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	001280	中国铀业	101,198.16	0.02	新股限售
2	301656	联合动力	98,377.44	0.02	新股限售
3	001233	海安集团	19,195.60	0.00	新股限售
4	301632	广东建科	15,534.08	0.00	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

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		西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,944	58,834.22	253,899,204.00	72.60%	95,811,407.00	27.40%	112,133,371.00	32.06%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	东方财富证券股份有限公司	118,379,777.00	33.85%
2	上海柏泰华盈私募基金管理有限公司－柏泰华盈常青藤套利2号私募证券投资基金	16,975,702.00	4.85%
3	于淑杰	3,500,000.00	1.00%
4	於之华	2,815,000.00	0.80%

5	北银理财有限责任公司－北银理财京华汇盈秋系列多元配置190天持有期理财产品	1,793,300.00	0.51%
6	欧丽君	1,253,100.00	0.36%
7	杨宁	1,040,400.00	0.30%
8	杨弘涛	1,000,000.00	0.29%
9	博瑞私募基金管理（海南）有限公司－博瑞安鑫1号私募证券投资基金	956,600.00	0.27%
10	UBS AG	946,800.00	0.27%
11	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	112,133,371.00	32.06%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,800.00	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2024年09月02日)基金份额总额	211,710,611.00
本报告期期初基金份额总额	825,710,611.00
本报告期基金总申购份额	562,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,038,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	349,710,611.00

§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：自2025年3月26日起，顾勇先生担任东财基金管理有限公司副总经理职务；2025年9月5日，郜杰先生因个人原因离任东财基金管理有限公司督察长职务，同日，由总经理沙福贵代任督察长职务。

基金托管人：本报告期内，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

本基金本报告期内未改变投资策略。

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40,000.00元，该事务所已向本基金提供了2年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员没有受到调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东财证券	6	1,974,807,055.19	100.00%	383,046.59	100.00%	-

1、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。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况等因素的基础上，选择证券经纪商。

3、选择券商的程序：

（1）本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；

（2）本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

4、本部分的数据统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《西藏东财基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）》统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东财证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年第4季度报告	证监会规定网站	2025-01-22
2	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	2025-01-25
3	西藏东财基金管理有限公司高级管理人员任职公告	证监会规定网站及报刊	2025-03-26
4	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年年度报告	证监会规定网站	2025-03-28
5	西藏东财基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）	证监会规定网站及报刊	2025-03-28
6	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金2025年第1季度报告	证监会规定网站	2025-04-22
7	西藏东财基金管理有限公司旗下部分基金增加中国银河证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	证监会规定网站及报刊	2025-04-25
8	西藏东财基金管理有限公司旗下部分基金增加国泰海通证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	证监会规定网站及报刊	2025-05-13
9	西藏东财基金管理有限公司旗下部分基金增加国泰海通证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	证监会规定网站及报刊	2025-05-29
10	西藏东财基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整	证监会规定网站及报刊	2025-06-06

	情况的公告		
11	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2025-06-28
12	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2025-06-28
13	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金2025年第2季度报告	证监会规定网站	2025-07-19
14	西藏东财基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用本公司名义进行诈骗活动的提示性公告	证监会规定网站及报刊	2025-08-20
15	西藏东财基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	证监会规定网站及报刊	2025-09-04
16	西藏东财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2025-09-06
17	关于公司法定名称变更的公告	证监会规定网站及报刊	2025-09-16
18	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2025-09-18
19	东财基金管理有限公司旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	证监会规定网站及报刊	2025-10-14
20	东财基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用本公司名义进行诈骗活动的提示性公告	证监会规定网站及报刊	2025-10-16
21	西藏东财中证500交易型开	证监会规定网站	2025-10-28

	放式指数证券投资基金2025年第3季度报告		
22	关于东财基金管理有限公司上海分公司法定名称变更的公告	证监会规定网站及报刊	2025-11-22
23	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2025-12-22
24	东财基金管理有限公司关于旗下部分深交所ETF变更场内简称的公告	证监会规定网站及报刊	2025-12-22
25	东财基金管理有限公司关于旗下部分基金2026年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证监会规定网站及报刊	2025-12-29
26	关于新增东方证券股份有限公司为部分基金流动性服务商的公告	证监会规定网站及报刊	2025-12-31

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025-01-01至2025-12-31	502,000,000.00	727,518,993.00	1,111,139,216.00	118,379,777.00	33.85%
ETF联接基金	1	2025-01-01至2025-01-02, 2025-07-18至2025-08-18, 2025-08-20至2025-08-24, 2025-09-02至2025-12-31	177,744,571.00	9,294,000.00	74,905,200.00	112,133,371.00	32.06%
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。

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。

在本报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人发生如下高级管理人员变动：2026年2月13日，倪永彪先生担任东财基金管理有限公司督察长职务，同日离任总经理助理职务；沙福贵先生结束代任督察长职务。2026年2月27日，顾勇先生担任东财基金管理有限公司总经理、财务负责人职务，同日离任副总经理职务；沙福贵先生离任总经理、财务负责人职务。

§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500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500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

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。

东财基金管理有限公司

二〇二六年三月三十一日