

---

# 西藏东财中证 500 指数型发起式证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:西藏东财基金管理有限公司

基金托管人:中国国际金融股份有限公司

送出日期:2024 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2024年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
§4 管理人报告 .....	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合规守信情况的说明.....	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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	13
§5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
§7 投资组合报告.....	53
7.1 期末基金资产组合情况.....	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	54
7.3 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 .....	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	76
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	76
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	76
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	76
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	76
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	76
7.12 投资组合报告附注.....	76
§8 基金份额持有人信息.....	78
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	78
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	79
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	79
§9 开放式基金份额变动.....	79
§10 重大事件揭示.....	80
10.1 基金份额持有人大会决议.....	80
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	80
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	80
10.4 基金投资策略的改变 .....	80
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	80
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	80
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
10.8 其他重大事件 .....	81
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
§12 备查文件目录.....	82
12.1 备查文件目录 .....	82
12.2 存放地点.....	83
12.3 查阅方式.....	83

## §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	220,597,166.93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	148,512,637.63份	72,084,529.30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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金中期报告备置地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	东财中证500A	东财中证500C
本期已实现收益	-6,345,166.58	-3,194,885.70
本期利润	-10,023,130.68	-5,009,508.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0664	-0.0681
本期加权平均净值利润率	-7.12%	-7.40%
本期基金份额净值增长率	-7.01%	-7.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-16,072,616.67	-8,681,575.86
期末可供分配基金份额利润	-0.1082	-0.1204
期末基金资产净值	132,440,020.96	63,402,953.44
期末基金份额净值	0.8918	0.8796
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-10.82%	-12.04%

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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-5.94%	0.91%	-6.55%	0.91%	0.61%	0.00%
过去三个月	-4.95%	1.08%	-6.16%	1.09%	1.21%	-0.01%
过去六个月	-7.01%	1.52%	-8.46%	1.53%	1.45%	-0.01%
过去一年	-13.72%	1.20%	-16.71%	1.21%	2.99%	-0.01%
过去三年	-16.84%	1.13%	-26.00%	1.14%	9.16%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-10.82%	1.11%	-22.38%	1.11%	11.56%	0.00%

## 东财中证500C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.97%	0.91%	-6.55%	0.91%	0.58%	0.00%
过去三个月	-5.04%	1.08%	-6.16%	1.09%	1.12%	-0.01%
过去六个月	-7.19%	1.52%	-8.46%	1.53%	1.27%	-0.01%
过去一年	-14.07%	1.20%	-16.71%	1.21%	2.64%	-0.01%
过去三年	-17.83%	1.13%	-26.00%	1.14%	8.17%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-12.04%	1.11%	-22.38%	1.11%	10.34%	0.00%

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



东财中证500A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年01月20日-2024年06月30日)



东财中证500C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年01月20日-2024年06月30日)



注：1、本基金基金合同于2021年1月20日生效。

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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2024年6月30日，公司旗下管理46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。

#### 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	-	7年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。历任中欧国际工商学院金融学/会计学研究助理、西藏东财基金管理有限公司筹备组成员，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兼研究员等职务。
莫志刚	本基金基金经理助理	2022-10-31	-	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、本基金基金经理助理莫志刚先生于2024年7月17日离任。

#### 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 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2024年06月30日，东财中证500A份额净值为0.8918元，报告期内基金份额净值增长率为-7.01%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；东财中证500C份额净值为0.8796元，报告期内基金份额净值增长率为-7.19%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年以来，外部环境复杂性严峻性不确定性明显上升、国内结构调整持续深化等带来新挑战，一季度经济运行实现良好开局，二季度"形有波动、势仍向好"。总体来说，上半年国民经济延续恢复向好态势，运行总体平稳，稳中有进，GDP同比增长5.0%，中国经济温和复苏的趋势愈发明显，新旧发展动能正加速转换，但仍面临有效需求不足、社会预期偏弱等挑战。

2024年上半年，A股跌宕起伏，行业轮动和主题投资切换较快。截至6月末，上证指数、深证成指、创业板指、北证50指数分别下跌0.25%、7.1%、10.99%和34.52%，沪深300上涨0.89%。总体看，A股上半年大盘价值优于中小盘成长风格，新国九条政策的推出进一步推动了市场向大盘价值风格的转变，银行、家电、煤炭、石油石化、电力及公用事业等行业涨幅居前。

展望2024年下半年，伴随着美联储进入降息周期，2024年全球货币环境或将转向宽松，外部流动性压力趋于缓解，随着市场情绪的修复，外资对于A股港股的低配态势也有望迎来逆转，带来外资的持续回流，中国资本市场的结构性机会将更为丰富。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	10,602,072.71	11,890,313.00
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	185,709,247.07	208,436,801.82
其中：股票投资		185,709,247.07	208,436,801.82
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		15,598.20	-
应收申购款		207,036.79	27,159.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	9,035.96	13,356.27
资产总计		196,542,990.73	220,367,630.27
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		383,242.76	304,300.34
应付管理人报酬		83,385.04	93,591.97
应付托管费		8,338.49	9,359.19
应付销售服务费		21,453.05	24,561.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		991.74	2,044.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	202,605.25	265,458.67
负债合计		700,016.33	699,315.75
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.7	220,597,166.93	229,960,537.84
未分配利润	6.4.7.8	-24,754,192.53	-10,292,223.32
净资产合计		195,842,974.40	219,668,314.52
负债和净资产总计		196,542,990.73	220,367,630.27

注：报告截止日2024年6月30日，东财中证500A基金份额净值人民币0.8918元，基金份额总额148,512,637.63份；东财中证500C基金份额净值人民币0.8796元，基金份额总额72,084,529.30份。基金份额总额合计为220,597,166.93份。

## 6.2 利润表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-14,230,680.50	10,645,169.93
1.利息收入		545,462.97	349,472.23
其中：存款利息收入	6.4.7.9	31,438.10	32,881.05
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		514,024.87	316,591.18
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-9,299,560.65	-56,030.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-11,893,119.60	-2,637,473.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-



衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,593,558.95	2,581,442.69
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,492,587.39	10,349,673.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,004.57	2,055.62
<b>减：二、营业总支出</b>		801,959.17	874,519.38
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	519,349.54	576,923.10
2.托管费	6.4.10.2.2	51,934.96	57,692.36
3.销售服务费	6.4.10.2.3	134,954.11	142,719.91
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		1,851.44	1,140.32
8.其他费用	6.4.7.19	93,869.12	96,043.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-15,032,639.67	9,770,650.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-15,032,639.67	9,770,650.55
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-15,032,639.67	9,770,650.55

### 6.3 净资产变动表

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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	229,960,537.84	-10,292,223.32	219,668,314.52
二、本期期初净资产	229,960,537.84	-10,292,223.32	219,668,314.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,363,370.91	-14,461,969.21	-23,825,340.12
（一）、综合收益总额	-	-15,032,639.67	-15,032,639.67
（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）	-9,363,370.91	570,670.46	-8,792,700.45
其中：1.基金申购款	57,866,114.00	-5,208,970.62	52,657,143.38
2.基金赎回款	-67,229,484.91	5,779,641.08	-61,449,843.83
（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	220,597,166.93	-24,754,192.53	195,842,974.40
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	228,779,991.81	-2,048,163.74	226,731,828.07

二、本期期初净资产	228,779,991.81	-2,048,163.74	226,731,828.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,160,084.39	9,042,062.47	13,202,146.86
（一）、综合收益总额	-	9,770,650.55	9,770,650.55
（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）	4,160,084.39	-728,588.08	3,431,496.31
其中：1.基金申购款	43,477,417.40	1,461,273.21	44,938,690.61
2.基金赎回款	-39,317,333.01	-2,189,861.29	-41,507,194.30
（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	232,940,076.20	6,993,898.73	239,933,974.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

沙福贵

侯福岩

陆文澄

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人西藏东财基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《西藏东财中证500指数型发起式证券投

资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3222号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为405,219,850.31份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（21）第00018号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2021年1月20日正式生效。本基金的基金管理人为西藏东财基金管理有限公司，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

根据《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 $\times 95\%$  + 银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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。

#### 6.4.3 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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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；

(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；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；

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	5,291,679.72
等于：本金	5,290,563.94
加：应计利息	1,115.78
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	5,310,392.99
等于：本金	5,309,625.03
加：应计利息	767.96
减：坏账准备	-
合计	10,602,072.71

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。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	226,531,509.39	-	185,709,247.07	-40,822,262.32
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	226,531,509.39	-	185,709,247.07	-40,822,262.32

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
	应收利息

其他应收款	9,035.96
待摊费用	-
合计	9,035.96

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	181.25
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	11,933.74
预提费用-信息披露费	169,672.34
其他应付	20,817.92
合计	202,605.25

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 东财中证500A

金额单位：人民币元

项目 (东财中证500A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	153,874,609.62	153,874,609.62
本期申购	16,806,409.35	16,806,409.35
本期赎回（以“-”号填列）	-22,168,381.34	-22,168,381.34
本期末	148,512,637.63	148,512,637.63

##### 6.4.7.7.2 东财中证500C



金额单位：人民币元

项目 (东财中证500C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	76,085,928.22	76,085,928.22
本期申购	41,059,704.65	41,059,704.65
本期赎回(以“-”号填列)	-45,061,103.57	-45,061,103.57
本期末	72,084,529.30	72,084,529.30

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

**6.4.7.8 未分配利润****6.4.7.8.1 东财中证500A**

单位：人民币元

项目 (东财中证500A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,216,914.24	-27,531,077.01	-6,314,162.77
本期期初	21,216,914.24	-27,531,077.01	-6,314,162.77
本期利润	-6,345,166.58	-3,677,964.10	-10,023,130.68
本期基金份额交易产生的变动数	-627,203.38	891,880.16	264,676.78
其中：基金申购款	2,050,166.05	-3,346,579.90	-1,296,413.85
基金赎回款	-2,677,369.43	4,238,460.06	1,561,090.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,244,544.28	-30,317,160.95	-16,072,616.67

**6.4.7.8.2 东财中证500C**

单位：人民币元

项目 (东财中证500C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,532,851.77	-13,510,912.32	-3,978,060.55
本期期初	9,532,851.77	-13,510,912.32	-3,978,060.55
本期利润	-3,194,885.70	-1,814,623.29	-5,009,508.99

本期基金份额交易产生的变动数	-425,149.00	731,142.68	305,993.68
其中：基金申购款	4,534,860.60	-8,447,417.37	-3,912,556.77
基金赎回款	-4,960,009.60	9,178,560.05	4,218,550.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,912,817.07	-14,594,392.93	-8,681,575.86

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	20,337.79	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	11,100.31	
结算备付金利息收入	-	
其他	-	
合计	31,438.10	

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额	56,252,822.99	
减：卖出股票成本总额	68,010,444.98	
减：交易费用	135,497.61	
买卖股票差价收入	-11,893,119.60	

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,593,558.95
其中：证券出借权益补偿收入	298,463.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,593,558.95

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-5,492,587.39
——股票投资	-5,492,587.39
——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	-5,492,587.39

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	15,981.44
转换费收入	23.13
合计	16,004.57

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期未发生信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	11,933.74
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,489.12
指数使用费	20,773.92
合计	93,869.12

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东财证券	106,168,689.35	100.00%	103,793,535.06	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东财证券	100,511.43	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东财证券	108,975.43	100.00%	-	-

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

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	519,349.54	576,923.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	233,326.39	261,716.69
应支付基金管理人的净管理费	286,023.15	315,206.41

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

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年06月30日	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	51,934.96	57,692.36

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

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财中证500A	东财中证500C	合计
天天基金	0.00	73,498.17	73,498.17
东财证券	0.00	19,518.36	19,518.36
合计	0.00	93,016.53	93,016.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财中证500A	东财中证500C	合计
西藏东财	0.00	15,375.42	15,375.42

基金管理 有限公司			
天天基金	0.00	92,165.84	92,165.84
东财证券	0.00	24,322.96	24,322.96
合计	0.00	131,864.22	131,864.22

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

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年06月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中金公司	11,621,348.00	2.00	2.00	7,522.24	10,685,996.00	7,747.92
东财证券	1,115,778.00	3.00	3.00	1,263.83	-	-
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	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	926,564.00	3.00	3.00	784.54	912,501.00	784.54



**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

东财中证500A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,899,819.83	10,899,819.83
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,899,819.83	10,899,819.83
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.34%	7.30%

东财中证500C

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

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

东财中证500A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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
东财证券	6,534,957.42	4.40%	6,534,957.42	4.25%

注：1、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。

2、本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有C类基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中金公司-托管户	5,291,679.72	20,337.79	5,458,833.96	20,465.76
东财证券-证券资金户	5,310,392.99	11,100.31	7,517,360.93	12,415.29

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

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内（含）	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内（含）	新股未上市	18.65	18.65	926	17,269.90	17,269.90	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	新股限售	86.96	174.93	77	6,695.92	13,469.61	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股限售	55.82	91.24	145	5,805.28	13,229.80	其中41股为锁定期送股所得
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	新股限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	新股限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301580	C爱迪特	2024-06-19	6个月	新股限售	44.95	65.93	129	5,798.55	8,504.97	-
301591	肯特股份	2024-02-	6个月	新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

		20								
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	新股限售	15.69	18.79	408	6,401.52	7,666.32	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	新股限售	21.73	25.26	266	5,780.18	6,719.16	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股限售	17.43	34.56	176	3,067.68	6,082.56	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股限售	16.20	15.96	303	4,908.60	4,835.88	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月	新股限售	26.00	37.49	116	3,016.00	4,348.84	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股限售	17.39	20.60	141	2,451.99	2,904.60	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股限售	19.18	22.66	123	2,359.14	2,787.18	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股限售	21.28	29.49	94	2,000.32	2,772.06	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股限售	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	其中40股为锁定期送股所得
603375	盛景微	2024-01-	6个月	新股限售	38.18	38.90	60	2,290.80	2,334.00	-

		17								
603381	C永臻	2024-06-19	6个月	新股限售	23.35	25.13	90	2,101.50	2,261.70	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	新股限售	72.46	68.06	33	2,391.18	2,245.98	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股限售	16.98	13.48	165	2,801.70	2,224.20	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	新股限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股限售	29.02	25.36	81	2,350.62	2,054.16	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股限售	18.65	18.65	103	1,920.95	1,920.95	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023-08-30	重大事项停牌	-	-	-	154,400	389,991.21	-	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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。

**6.4.12.3.2 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。

**6.4.12.4 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	000021	深科技	2024年07月02日- 2024年07月02日	15.12	11,600	175,392.00
2	000066	中国长城	2024年07月02日- 2024年07月02日	8.75	24,000	210,000.00
3	000155	川能动力	2024年07月02日- 2024年07月02日	10.77	10,100	108,777.00
4	000401	冀东水泥	2024年07月02日- 2024年07月02日	4.06	13,200	53,592.00
5	000423	东阿阿胶	2024年07月12日- 2024年07月12日	62.60	5,600	350,560.00
6	000519	中兵红箭	2024年07月02日- 2024年07月02日	14.67	10,400	152,568.00
7	000537	中绿电	2024年07月02日- 2024年07月02日	9.53	7,700	73,381.00
8	000598	兴蓉环境	2024年07月12日- 2024年07月12日	7.52	10,000	75,200.00
9	000723	美锦能源	2024年07月10日- 2024年07月10日	4.76	32,300	153,748.00
10	000818	航锦科技	2024年07月02日- 2024年07月02日	22.08	6,700	147,936.00
11	000825	太钢不锈	2024年07月12日-	3.38	28,500	96,330.00

			2024年07月12日			
12	000831	中国稀土	2024年07月02日- 2024年07月02日	25.35	7,900	200,265.00
13	000887	中鼎股份	2024年07月02日- 2024年07月02日	12.24	9,800	119,952.00
14	000893	亚钾国际	2024年07月12日- 2024年07月12日	16.16	8,100	130,896.00
15	000921	海信家电	2024年07月02日- 2024年07月02日	32.24	5,700	183,768.00
16	000937	冀中能源	2024年07月02日- 2024年07月02日	6.70	13,200	88,440.00
17	000967	盈峰环境	2024年07月12日- 2024年07月12日	4.23	15,800	66,834.00
18	000988	华工科技	2024年07月12日- 2024年07月12日	29.93	12,500	374,125.00
19	002155	湖南黄金	2024年07月12日- 2024年07月12日	18.10	10,000	181,000.00
20	002156	通富微电	2024年07月02日- 2024年07月02日	22.39	13,100	293,309.00
21	002202	金风科技	2024年07月02日- 2024年07月02日	6.72	34,300	230,496.00
22	002261	拓维信息	2024年07月02日- 2024年07月02日	11.07	12,400	137,268.00
23	002353	杰瑞股份	2024年07月12日- 2024年07月12日	35.08	7,600	266,608.00
24	002368	太极股份	2024年07月02日- 2024年07月02日	22.55	5,400	121,770.00
25	002373	千方科技	2024年07月02日- 2024年07月02日	9.07	11,800	107,026.00
26	002385	大北农	2024年07月12日- 2024年07月12日	3.85	41,000	157,850.00
27	002407	多氟多	2024年07月12日- 2024年07月12日	12.23	14,800	181,004.00

28	002432	九安医疗	2024年07月02日- 2024年07月02日	40.54	4,800	194,592.00
29	002436	兴森科技	2024年07月02日- 2024年07月02日	10.32	21,000	216,720.00
30	002472	双环传动	2024年07月12日- 2024年07月12日	22.02	8,400	184,968.00
31	002487	大金重工	2024年07月02日- 2024年07月02日	22.88	4,700	107,536.00
32	002506	协鑫集成	2024年07月09日- 2024年07月09日	1.94	58,200	112,908.00
33	002563	森马服饰	2024年07月02日- 2024年07月02日	5.81	10,000	58,100.00
34	002568	百润股份	2024年07月02日- 2024年07月02日	16.83	6,500	109,395.00
35	002625	光启技术	2024年07月09日- 2024年07月09日	17.35	18,800	326,180.00
36	002936	郑州银行	2024年07月09日- 2024年07月09日	1.73	61,600	106,568.00
37	002945	华林证券	2024年07月12日- 2024年07月12日	9.98	3,300	32,934.00
38	300002	神州泰岳	2024年07月02日- 2024年07月02日	8.12	24,400	198,128.00
39	300070	碧水源	2024年07月12日- 2024年07月12日	4.19	20,000	83,800.00
40	300073	当升科技	2024年07月02日- 2024年07月02日	34.31	5,000	171,550.00
41	300114	中航电测	2024年07月12日- 2024年07月12日	45.25	3,600	162,900.00
42	300118	东方日升	2024年07月02日- 2024年07月02日	12.10	11,300	136,730.00
43	300212	易华录	2024年07月02日- 2024年07月02日	16.83	5,400	90,882.00



44	300438	鹏辉能源	2024年07月02日- 2024年07月02日	18.34	4,400	80,696.00
45	300487	蓝晓科技	2024年07月02日- 2024年07月02日	41.76	3,100	129,456.00
46	300567	精测电子	2024年07月02日- 2024年07月02日	56.51	2,400	135,624.00
47	300604	长川科技	2024年07月02日- 2024年07月02日	27.17	4,600	124,982.00
48	300682	朗新集团	2024年07月12日- 2024年07月12日	8.51	8,100	68,931.00
49	300724	捷佳伟创	2024年07月02日- 2024年07月02日	54.01	3,400	183,634.00
50	300765	新诺威	2024年07月02日- 2024年07月02日	25.23	5,200	131,196.00
51	300866	安克创新	2024年07月12日- 2024年07月12日	71.21	2,600	185,146.00
52	300888	稳健医疗	2024年07月02日- 2024年07月02日	25.30	2,900	73,370.00
53	301029	怡合达	2024年07月02日- 2024年07月02日	19.66	2,100	41,286.00
54	301236	软通动力	2024年07月02日- 2024年07月02日	35.21	7,100	249,991.00
55	301267	华夏眼科	2024年07月12日- 2024年07月12日	20.72	3,100	64,232.00
56	301358	湖南裕能	2024年07月02日- 2024年07月02日	31.46	5,600	176,176.00
57	600008	首创环保	2024年07月09日- 2024年07月09日	2.68	54,800	146,864.00
58	600032	浙江新能	2024年07月02日- 2024年07月02日	7.28	8,900	64,792.00
59	600095	湘财股份	2024年07月02日- 2024年07月02日	5.96	10,600	63,176.00

60	600129	太极集团	2024年07月02日- 2024年07月02日	28.92	4,800	138,816.00
61	600131	国网信通	2024年07月02日- 2024年07月02日	16.87	7,400	124,838.00
62	600141	兴发集团	2024年07月12日- 2024年07月12日	19.08	9,600	183,168.00
63	600166	福田汽车	2024年07月09日- 2024年07月09日	2.25	59,800	134,550.00
64	600208	新湖中宝	2024年07月03日- 2024年07月03日	1.58	50,000	79,000.00
65	600271	航天信息	2024年07月12日- 2024年07月12日	7.36	13,800	101,568.00
66	600315	上海家化	2024年07月02日- 2024年07月02日	17.78	4,200	74,676.00
67	600316	洪都航空	2024年07月12日- 2024年07月12日	16.63	5,300	88,139.00
68	600329	达仁堂	2024年07月02日- 2024年07月02日	32.39	3,500	113,365.00
69	600339	中油工程	2024年07月02日- 2024年07月02日	3.12	20,800	64,896.00
70	600352	浙江龙盛	2024年07月12日- 2024年07月12日	8.59	32,500	279,175.00
71	600378	昊华科技	2024年07月02日- 2024年07月02日	28.90	3,400	98,260.00
72	600392	盛和资源	2024年07月02日- 2024年07月02日	8.62	17,400	149,988.00
73	600416	湘电股份	2024年07月12日- 2024年07月12日	9.94	11,600	115,304.00
74	600418	江淮汽车	2024年07月02日- 2024年07月02日	15.84	21,700	343,728.00
75	600435	北方导航	2024年07月02日- 2024年07月02日	8.62	13,000	112,060.00

76	600481	双良节能	2024年07月02日- 2024年07月02日	4.67	13,900	64,913.00
77	600483	福能股份	2024年07月02日- 2024年07月02日	11.66	9,500	110,770.00
78	600486	扬农化工	2024年07月12日- 2024年07月12日	56.45	3,000	169,350.00
79	600536	中国软件	2024年07月02日- 2024年07月02日	29.92	7,400	221,408.00
80	600754	锦江酒店	2024年07月12日- 2024年07月12日	22.98	5,700	130,986.00
81	600763	通策医疗	2024年07月02日- 2024年07月02日	54.05	2,800	151,340.00
82	600764	中国海防	2024年07月02日- 2024年07月02日	19.63	2,600	51,038.00
83	600808	马钢股份	2024年07月12日- 2024年07月12日	2.02	20,000	40,400.00
84	600839	四川长虹	2024年07月12日- 2024年07月12日	4.49	40,000	179,600.00
85	600859	王府井	2024年07月02日- 2024年07月02日	11.74	9,800	115,052.00
86	600863	内蒙华电	2024年07月12日- 2024年07月12日	4.64	10,000	46,400.00
87	600884	杉杉股份	2024年07月12日- 2024年07月12日	8.12	14,100	114,492.00
88	600895	张江高科	2024年07月02日- 2024年07月02日	18.48	9,600	177,408.00
89	600901	江苏金租	2024年07月02日- 2024年07月02日	5.05	21,700	109,585.00
90	600956	新天绿能	2024年07月02日- 2024年07月02日	8.17	3,800	31,046.00
91	600968	海油发展	2024年07月12日- 2024年07月12日	4.12	25,400	104,648.00

92	600998	九州通	2024年07月12日- 2024年07月12日	4.88	31,400	153,232.00
93	601106	中国一重	2024年07月12日- 2024年07月12日	2.31	34,200	79,002.00
94	601118	海南橡胶	2024年07月02日- 2024年07月02日	4.55	21,200	96,460.00
95	601139	深圳燃气	2024年07月12日- 2024年07月12日	6.68	7,200	48,096.00
96	601155	新城控股	2024年07月12日- 2024年07月12日	8.87	10,000	88,700.00
97	601156	东航物流	2024年07月12日- 2024年07月12日	20.35	7,900	160,765.00
98	601179	中国西电	2024年07月02日- 2024年07月02日	8.04	25,500	205,020.00
99	601212	白银有色	2024年07月02日- 2024年07月02日	2.78	36,800	102,304.00
10 0	601231	环旭电子	2024年07月12日- 2024年07月12日	16.05	8,200	131,610.00
10 1	601456	国联证券	2024年07月02日- 2024年07月02日	9.64	14,800	142,672.00
10 2	601567	三星医疗	2024年07月02日- 2024年07月02日	35.00	8,700	304,500.00
10 3	601615	明阳智能	2024年07月02日- 2024年07月02日	9.44	22,600	213,344.00
10 4	601666	平煤股份	2024年07月09日- 2024年07月09日	11.20	18,500	207,200.00
10 5	601828	美凯龙	2024年07月02日- 2024年07月02日	2.55	13,400	34,170.00
10 6	601858	中国科传	2024年07月12日- 2024年07月12日	19.12	1,900	36,328.00
10 7	601866	中远海发	2024年07月12日- 2024年07月12日	2.58	10,000	25,800.00

10 8	601933	永辉超市	2024年07月09日- 2024年07月09日	2.48	56,500	140,120.00
10 9	601965	中国汽研	2024年07月02日- 2024年07月02日	16.89	5,000	84,450.00
11 0	603000	人民网	2024年07月02日- 2024年07月02日	19.99	6,800	135,932.00
11 1	603179	新泉股份	2024年07月02日- 2024年07月02日	39.24	4,200	164,808.00
11 2	603185	弘元绿能	2024年07月02日- 2024年07月02日	17.09	3,300	56,397.00
11 3	603228	景旺电子	2024年07月09日- 2024年07月09日	31.80	4,200	133,560.00
11 4	603233	大参林	2024年07月02日- 2024年07月02日	14.30	5,600	80,080.00
11 5	603486	科沃斯	2024年07月02日- 2024年07月02日	47.18	2,800	132,104.00
11 6	603517	绝味食品	2024年07月12日- 2024年07月12日	15.40	4,600	70,840.00
11 7	603650	彤程新材	2024年07月02日- 2024年07月02日	29.55	3,000	88,650.00
11 8	603658	安图生物	2024年07月02日- 2024年07月02日	46.07	2,900	133,603.00
11 9	603712	七一二	2024年07月02日- 2024年07月02日	18.19	5,700	103,683.00
12 0	603737	三棵树	2024年07月02日- 2024年07月02日	36.27	2,600	94,302.00
12 1	603883	老百姓	2024年07月12日- 2024年07月12日	18.36	5,600	102,816.00
12 2	603979	金诚信	2024年07月02日- 2024年07月02日	50.53	4,600	232,438.00
12 3	605358	立昂微	2024年07月02日- 2024年07月02日	23.14	6,600	152,724.00

12 4	688005	容百科技	2024年07月12日- 2024年07月12日	23.28	4,200	97,776.00
12 5	688006	杭可科技	2024年07月12日- 2024年07月12日	17.45	3,000	52,350.00
12 6	688065	凯赛生物	2024年07月02日- 2024年07月02日	45.39	3,600	163,404.00
12 7	688172	燕东微	2024年07月02日- 2024年07月02日	16.18	2,900	46,922.00
12 8	688180	君实生物	2024年07月02日- 2024年07月02日	29.05	6,600	191,730.00
12 9	688297	中无人机	2024年07月02日- 2024年07月02日	33.03	2,500	82,575.00
13 0	688331	荣昌生物	2024年07月02日- 2024年07月02日	43.20	2,100	90,720.00
13 1	688387	信科移动	2024年07月02日- 2024年07月02日	5.04	8,500	42,840.00
13 2	688521	芯原股份	2024年07月02日- 2024年07月02日	26.75	4,300	115,025.00
13 3	688525	佰维存储	2024年07月09日- 2024年07月09日	64.15	3,200	205,280.00
13 4	688567	孚能科技	2024年07月12日- 2024年07月12日	9.60	9,100	87,360.00
13 5	688777	中控技术	2024年07月12日- 2024年07月12日	37.70	7,800	294,060.00
13 6	688779	长远锂科	2024年07月12日- 2024年07月12日	4.63	12,000	55,560.00
合计	-	-	-	-	1,723,600	18,132,817.00

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数基金，采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

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

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口



单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,602,072.71	-	-	-	10,602,072.71
交易性金融资产	-	-	-	185,709,247.07	185,709,247.07
应收股利	-	-	-	15,598.20	15,598.20
应收申购款	-	-	-	207,036.79	207,036.79
其他资产	-	-	-	9,035.96	9,035.96
资产总计	10,602,072.71	-	-	185,940,918.02	196,542,990.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	383,242.76	383,242.76
应付管理人报酬	-	-	-	83,385.04	83,385.04
应付托管费	-	-	-	8,338.49	8,338.49
应付销售服务费	-	-	-	21,453.05	21,453.05
应交税费	-	-	-	991.74	991.74
其他负债	-	-	-	202,605.25	202,605.25
负债总计	-	-	-	700,016.33	700,016.33
利率敏	10,602,072.71	-	-	185,240,901.69	195,842,974.40

感度缺口					
上年度末 2023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	11,890,313.00	-	-	-	11,890,313.00
交易性金融资产	-	-	-	208,436,801.82	208,436,801.82
应收申购款	-	-	-	27,159.18	27,159.18
其他资产	-	-	-	13,356.27	13,356.27
资产总计	11,890,313.00	-	-	208,477,317.27	220,367,630.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	304,300.34	304,300.34
应付管理人报酬	-	-	-	93,591.97	93,591.97
应付托管费	-	-	-	9,359.19	9,359.19
应付销售服务费	-	-	-	24,561.14	24,561.14
应交税费	-	-	-	2,044.44	2,044.44
其他负债	-	-	-	265,458.67	265,458.67
负债总计	-	-	-	699,315.75	699,315.75
利率敏	11,890,313.00	-	-	207,778,001.52	219,668,314.52

感度缺口					
------	--	--	--	--	--

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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	185,709,247.07	94.83	208,436,801.82	94.89
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	185,709,247.07	94.83	208,436,801.82	94.89

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	9,649,822.86	10,894,681.70
	业绩比较基准下降5%	-9,649,822.86	-10,894,681.70

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	185,532,782.70	207,756,231.29
第二层次	40,799.41	-
第三层次	135,664.96	680,570.53
合计	185,709,247.07	208,436,801.82

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2023年12月31日：无）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	185,709,247.07	94.49
	其中：股票	185,709,247.07	94.49
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	10,602,072.71	5.39
8	其他各项资产	231,670.95	0.12
9	合计	196,542,990.73	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为18,132,817.00元，占基金资产净值比例为9.26%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,161,467.00	0.59
B	采矿业	8,660,379.26	4.42
C	制造业	117,183,245.96	59.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,459,515.90	3.81
E	建筑业	1,885,236.00	0.96
F	批发和零售业	3,932,541.04	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,726,794.00	1.90
H	住宿和餐饮业	587,210.65	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,169,156.69	6.72
J	金融业	17,212,650.22	8.79
K	房地产业	2,095,835.00	1.07
L	租赁和商务服务业	1,414,571.00	0.72

M	科学研究和技术服务业	1,481,707.56	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	839,931.20	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	206,244.00	0.11
Q	卫生和社会工作	1,150,994.00	0.59
R	文化、体育和娱乐业	2,783,485.00	1.42
S	综合	330,880.00	0.17
	合计	185,281,844.48	94.61

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	236,977.89	0.12
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	10,870.86	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	341.60	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,516.05	0.04
J	金融业	33.40	0.00
K	房地产业	99,826.91	0.05
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	4,835.88	0.00
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	427,402.59	0.22

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	22,200	2,343,210.00	1.20
2	002028	思源电气	19,200	1,284,480.00	0.66
3	601058	赛轮轮胎	82,082	1,149,148.00	0.59
4	688169	石头科技	2,864	1,124,406.40	0.57
5	600066	宇通客车	41,500	1,070,700.00	0.55
6	002340	格林美	160,300	1,021,111.00	0.52
7	000933	神火股份	49,200	995,316.00	0.51
8	601077	渝农商行	193,300	970,366.00	0.50
9	000988	华工科技	31,400	939,802.00	0.48
10	601168	西部矿业	52,100	935,195.00	0.48
11	300394	天孚通信	10,340	914,262.80	0.47
12	002384	东山精密	42,700	883,890.00	0.45
13	000423	东阿阿胶	14,100	882,660.00	0.45
14	000630	铜陵有色	239,600	864,956.00	0.44
15	600418	江淮汽车	54,500	863,280.00	0.44
16	600988	赤峰黄金	51,939	848,683.26	0.43



17	601233	桐昆股份	52,700	841,092.00	0.43
18	600157	永泰能源	693,600	818,448.00	0.42
19	002625	光启技术	47,100	817,185.00	0.42
20	600096	云天化	40,100	778,742.00	0.40
21	601567	三星医疗	22,000	770,000.00	0.39
22	000400	许继电气	22,300	767,343.00	0.39
23	002156	通富微电	33,100	741,109.00	0.38
24	688777	中控技术	19,649	740,767.30	0.38
25	002128	电投能源	35,000	738,500.00	0.38
26	002273	水晶光电	43,430	737,441.40	0.38
27	601555	东吴证券	124,060	731,954.00	0.37
28	002078	太阳纸业	52,300	729,585.00	0.37
29	600885	宏发股份	26,080	721,894.40	0.37
30	601128	常熟银行	94,150	712,715.50	0.36
31	002223	鱼跃医疗	18,800	706,880.00	0.36
32	002532	天山铝业	87,100	706,381.00	0.36
33	300207	欣旺达	46,500	705,405.00	0.36
34	600873	梅花生物	70,000	701,400.00	0.36
35	600352	浙江龙盛	81,300	698,367.00	0.36
36	600398	海澜之家	75,000	693,000.00	0.35
37	002138	顺络电子	25,200	691,992.00	0.35
38	002966	苏州银行	91,570	686,775.00	0.35
39	002353	杰瑞股份	19,200	673,536.00	0.34
40	601108	财通证券	101,500	670,915.00	0.34
41	688617	惠泰医疗	1,455	663,625.50	0.34
42	600765	中航重机	32,360	660,144.00	0.34
43	002185	华天科技	80,000	652,000.00	0.33
44	002517	恺英网络	67,200	641,760.00	0.33
45	600879	航天电子	82,400	640,248.00	0.33
46	301236	软通动力	17,900	630,259.00	0.32
47	603606	东方电缆	12,900	629,649.00	0.32

48	600177	雅戈尔	86,700	617,304.00	0.32
49	688099	晶晨股份	10,406	617,283.92	0.32
50	601577	长沙银行	75,300	615,954.00	0.31
51	600079	人福医药	35,700	612,969.00	0.31
52	600109	国金证券	81,100	612,305.00	0.31
53	002738	中矿资源	22,780	610,504.00	0.31
54	300003	乐普医疗	41,100	609,924.00	0.31
55	600060	海信视像	24,500	606,130.00	0.31
56	300017	网宿科技	76,200	601,980.00	0.31
57	600497	驰宏锌锗	111,300	594,342.00	0.30
58	300136	信维通信	30,200	591,316.00	0.30
59	603160	汇顶科技	8,600	591,250.00	0.30
60	603979	金诚信	11,600	586,148.00	0.30
61	002202	金风科技	86,200	579,264.00	0.30
62	002739	万达电影	47,600	575,484.00	0.29
63	000932	华菱钢铁	129,400	573,242.00	0.29
64	689009	九号公司	15,560	572,763.60	0.29
65	000683	远兴能源	81,500	563,165.00	0.29
66	600536	中国软件	18,819	563,064.48	0.29
67	600985	淮北矿业	33,600	562,464.00	0.29
68	002465	海格通信	54,200	561,512.00	0.29
69	600348	华阳股份	56,350	561,246.00	0.29
70	002409	雅克科技	8,900	559,899.00	0.29
71	002281	光迅科技	14,900	556,813.00	0.28
72	002444	巨星科技	22,500	555,750.00	0.28
73	000009	中国宝安	64,400	553,840.00	0.28
74	688120	华海清科	2,890	547,886.20	0.28
75	002008	大族激光	26,300	547,040.00	0.28
76	000878	云南铜业	43,800	545,748.00	0.28
77	002436	兴森科技	52,700	543,864.00	0.28
78	688122	西部超导	14,140	541,844.80	0.28

79	300474	景嘉微	8,550	540,616.50	0.28
80	600642	申能股份	61,100	539,513.00	0.28
81	601615	明阳智能	56,700	535,248.00	0.27
82	002797	第一创业	105,000	534,450.00	0.27
83	000039	中集集团	57,500	532,450.00	0.27
84	300054	鼎龙股份	23,400	530,712.00	0.27
85	601990	南京证券	69,100	530,688.00	0.27
86	600298	安琪酵母	18,974	529,943.82	0.27
87	000066	中国长城	60,400	528,500.00	0.27
88	300012	华测检测	52,500	528,150.00	0.27
89	600529	山东药玻	20,700	524,538.00	0.27
90	601666	平煤股份	46,400	519,680.00	0.27
91	002673	西部证券	83,700	518,103.00	0.26
92	600839	四川长虹	115,300	517,697.00	0.26
93	603596	伯特利	13,300	517,370.00	0.26
94	688525	佰维存储	8,028	514,996.20	0.26
95	601179	中国西电	64,000	514,560.00	0.26
96	000831	中国稀土	19,900	504,465.00	0.26
97	000783	长江证券	103,600	500,388.00	0.26
98	601717	郑煤机	33,700	498,760.00	0.25
99	300395	菲利华	16,200	498,150.00	0.25
100	603816	顾家家居	15,400	497,266.00	0.25
101	300002	神州泰岳	61,200	496,944.00	0.25
102	000728	国元证券	81,700	495,102.00	0.25
103	002432	九安医疗	12,200	494,588.00	0.25
104	000738	航发控制	24,600	493,722.00	0.25
105	600862	中航高科	26,100	490,158.00	0.25
106	688188	柏楚电子	2,647	488,503.85	0.25
107	000703	恒逸石化	68,700	487,083.00	0.25
108	688180	君实生物	16,681	484,583.05	0.25
109	601198	东兴证券	60,500	481,580.00	0.25

110	601997	贵阳银行	91,300	481,151.00	0.25
111	603338	浙江鼎力	7,900	477,318.00	0.24
112	002595	豪迈科技	12,500	477,125.00	0.24
113	000960	锡业股份	30,800	477,092.00	0.24
114	002155	湖南黄金	26,300	476,030.00	0.24
115	603345	安井食品	6,400	475,584.00	0.24
116	600863	内蒙华电	101,900	472,816.00	0.24
117	601696	中银证券	52,000	472,160.00	0.24
118	601162	天风证券	216,400	471,752.00	0.24
119	300724	捷佳伟创	8,700	469,887.00	0.24
120	300037	新宙邦	16,440	469,526.40	0.24
121	300866	安克创新	6,590	469,273.90	0.24
122	600521	华海药业	27,500	468,875.00	0.24
123	600038	中直股份	11,400	468,654.00	0.24
124	000921	海信家电	14,500	467,480.00	0.24
125	002984	森麒麟	19,300	464,937.00	0.24
126	603939	益丰药房	18,932	464,780.60	0.24
127	300001	特锐德	23,100	464,772.00	0.24
128	002472	双环传动	21,100	464,622.00	0.24
129	002294	信立泰	17,400	463,362.00	0.24
130	600141	兴发集团	24,100	459,828.00	0.23
131	600549	厦门钨业	26,600	458,850.00	0.23
132	600699	均胜电子	30,800	456,456.00	0.23
133	002407	多氟多	37,240	455,445.20	0.23
134	600546	山煤国际	30,900	451,758.00	0.23
135	300699	光威复材	18,180	451,409.40	0.23
136	002850	科达利	5,900	450,642.00	0.23
137	002262	恩华药业	18,900	448,686.00	0.23
138	600820	隧道股份	68,700	448,611.00	0.23
139	600895	张江高科	24,200	447,216.00	0.23
140	301358	湖南裕能	14,200	446,732.00	0.23

141	600369	西南证券	124,500	445,710.00	0.23
142	002195	岩山科技	177,400	445,274.00	0.23
143	600872	中炬高新	19,600	444,724.00	0.23
144	002064	华峰化学	62,000	444,540.00	0.23
145	300285	国瓷材料	24,900	444,465.00	0.23
146	000021	深科技	29,200	441,504.00	0.23
147	603589	口子窖	11,200	438,928.00	0.22
148	300073	当升科技	12,700	435,737.00	0.22
149	603087	甘李药业	9,400	435,408.00	0.22
150	600021	上海电力	44,000	435,160.00	0.22
151	601000	唐山港	92,500	434,750.00	0.22
152	300146	汤臣倍健	31,900	432,245.00	0.22
153	600486	扬农化工	7,600	429,020.00	0.22
154	000513	丽珠集团	11,500	427,915.00	0.22
155	300058	蓝色光标	77,700	422,688.00	0.22
156	601966	玲珑轮胎	23,000	422,510.00	0.22
157	600704	物产中大	97,300	422,282.00	0.22
158	002756	永兴材料	11,800	422,204.00	0.22
159	600153	建发股份	46,900	418,817.00	0.21
160	600155	华创云信	70,600	417,246.00	0.21
161	300114	中航电测	9,200	416,300.00	0.21
162	000830	鲁西化工	35,900	416,081.00	0.21
163	603179	新泉股份	10,600	415,944.00	0.21
164	688065	凯赛生物	9,070	411,687.30	0.21
165	600118	中国卫星	18,500	411,255.00	0.21
166	300529	健帆生物	15,100	410,871.00	0.21
167	600583	海油工程	69,000	407,790.00	0.21
168	002558	巨人网络	43,100	406,864.00	0.21
169	002152	广电运通	38,800	405,848.00	0.21
170	601156	东航物流	19,800	402,930.00	0.21
171	000591	太阳能	85,400	402,234.00	0.21

172	000623	吉林敖东	29,900	400,660.00	0.20
173	002025	航天电器	8,600	398,868.00	0.20
174	600970	中材国际	33,000	397,980.00	0.20
175	300373	扬杰科技	10,200	396,780.00	0.20
176	002385	大北农	102,700	395,395.00	0.20
177	300144	宋城演艺	49,100	394,273.00	0.20
178	002439	启明星辰	22,800	393,528.00	0.20
179	600380	健康元	35,000	390,950.00	0.20
180	601216	君正集团	105,400	388,926.00	0.20
181	000729	燕京啤酒	44,000	388,520.00	0.20
182	605358	立昂微	16,784	388,381.76	0.20
183	600143	金发科技	58,400	386,024.00	0.20
184	000723	美锦能源	81,000	385,560.00	0.20
185	300251	光线传媒	45,800	385,178.00	0.20
186	600998	九州通	78,721	384,158.48	0.20
187	600282	南钢股份	77,000	383,460.00	0.20
188	600637	东方明珠	63,000	383,040.00	0.20
189	000519	中兵红箭	26,100	382,887.00	0.20
190	300383	光环新网	44,900	379,405.00	0.19
191	600516	方大炭素	88,000	379,280.00	0.19
192	300677	英科医疗	14,140	379,093.40	0.19
193	600763	通策医疗	7,000	378,350.00	0.19
194	600392	盛和资源	43,800	377,556.00	0.19
195	000636	风华高科	28,900	377,434.00	0.19
196	300024	机器人	38,700	376,938.00	0.19
197	000818	航锦科技	17,000	375,360.00	0.19
198	002958	青农商行	138,800	371,984.00	0.19
199	601665	齐鲁银行	75,500	370,705.00	0.19
200	600909	华安证券	88,040	370,648.40	0.19
201	002044	美年健康	97,800	369,684.00	0.19
202	600008	首创环保	137,500	368,500.00	0.19

203	000883	湖北能源	61,100	367,211.00	0.19
204	600566	济川药业	11,500	364,665.00	0.19
205	600511	国药股份	11,800	363,322.00	0.19
206	000629	钒钛股份	145,100	362,750.00	0.19
207	601016	节能风电	121,310	362,716.90	0.19
208	600867	通化东宝	43,300	362,421.00	0.19
209	688213	思特威	7,463	361,955.50	0.18
210	300088	长信科技	76,600	360,020.00	0.18
211	601456	国联证券	37,300	359,572.00	0.18
212	000997	新大陆	25,800	358,878.00	0.18
213	600170	上海建工	166,400	357,760.00	0.18
214	600582	天地科技	51,700	356,213.00	0.18
215	600499	科达制造	41,900	353,217.00	0.18
216	600498	烽火通信	22,200	352,980.00	0.18
217	600129	太极集团	12,200	352,824.00	0.18
218	600535	天士力	28,000	352,240.00	0.18
219	601933	永辉超市	141,700	351,416.00	0.18
220	002120	韵达股份	45,300	350,622.00	0.18
221	000598	兴蓉环境	46,600	350,432.00	0.18
222	600004	白云机场	36,900	349,812.00	0.18
223	601991	大唐发电	116,100	349,461.00	0.18
224	600580	卧龙电驱	28,700	348,705.00	0.18
225	000750	国海证券	119,600	348,036.00	0.18
226	002261	拓维信息	31,300	346,491.00	0.18
227	000060	中金岭南	81,700	346,408.00	0.18
228	603000	人民网	17,300	345,827.00	0.18
229	300118	东方日升	28,500	344,850.00	0.18
230	300567	精测电子	6,100	344,711.00	0.18
231	300568	星源材质	42,000	344,400.00	0.18
232	002430	杭氧股份	15,400	342,650.00	0.17
233	002429	兆驰股份	70,700	340,067.00	0.17

234	603486	科沃斯	7,200	339,696.00	0.17
235	002939	长城证券	50,400	337,680.00	0.17
236	600166	福田汽车	149,900	337,275.00	0.17
237	603156	养元饮品	15,822	336,533.94	0.17
238	603658	安图生物	7,300	336,311.00	0.17
239	600325	华发股份	51,600	335,400.00	0.17
240	603228	景旺电子	10,500	333,900.00	0.17
241	600816	建元信托	122,900	333,059.00	0.17
242	300765	新诺威	13,200	333,036.00	0.17
243	601231	环旭电子	20,700	332,235.00	0.17
244	600673	东阳光	47,000	330,880.00	0.17
245	300487	蓝晓科技	7,900	329,904.00	0.17
246	603927	中科软	18,168	328,659.12	0.17
247	600754	锦江酒店	14,300	328,614.00	0.17
248	000893	亚钾国际	20,300	328,048.00	0.17
249	603568	伟明环保	15,940	328,045.20	0.17
250	002508	老板电器	14,800	327,080.00	0.17
251	300601	康泰生物	20,900	326,249.00	0.17
252	000027	深圳能源	44,600	325,580.00	0.17
253	601636	旗滨集团	50,300	324,435.00	0.17
254	002926	华西证券	49,200	324,228.00	0.17
255	000998	隆平高科	32,900	323,407.00	0.17
256	002624	完美世界	42,400	322,240.00	0.16
257	603298	杭叉集团	16,400	322,096.00	0.16
258	002497	雅化集团	36,000	321,120.00	0.16
259	600737	中粮糖业	33,400	320,306.00	0.16
260	600563	法拉电子	4,200	319,956.00	0.16
261	002653	海思科	10,400	319,280.00	0.16
262	601866	中远海发	123,600	318,888.00	0.16
263	688052	纳芯微	3,102	318,823.56	0.16
264	603290	斯达半导	3,700	318,607.00	0.16



265	603077	和邦生物	193,000	318,450.00	0.16
266	300253	卫宁健康	53,900	318,010.00	0.16
267	300604	长川科技	11,700	317,889.00	0.16
268	002299	圣农发展	23,300	317,812.00	0.16
269	600131	国网信通	18,800	317,156.00	0.16
270	002065	东华软件	70,100	316,852.00	0.16
271	002056	横店东磁	25,400	316,738.00	0.16
272	002500	山西证券	67,200	315,840.00	0.16
273	300390	天华新能	18,330	314,909.40	0.16
274	600373	中文传媒	21,200	314,608.00	0.16
275	601958	金钼股份	30,200	314,382.00	0.16
275	300763	锦浪科技	7,550	314,382.00	0.16
277	002414	高德红外	53,300	313,937.00	0.16
278	688772	珠海冠宇	21,031	313,361.90	0.16
279	600655	豫园股份	60,800	313,120.00	0.16
280	688385	复旦微电	9,976	313,046.88	0.16
281	300009	安科生物	36,640	312,905.60	0.16
282	688002	睿创微纳	11,155	312,005.35	0.16
283	002507	涪陵榨菜	25,180	308,455.00	0.16
284	002368	太极股份	13,665	308,145.75	0.16
285	603893	瑞芯微	5,200	307,684.00	0.16
286	002372	伟星新材	19,900	306,858.00	0.16
287	688114	华大智造	6,462	306,363.42	0.16
288	600707	彩虹股份	44,800	305,088.00	0.16
289	601611	中国核建	37,700	304,993.00	0.16
290	603885	吉祥航空	27,600	303,324.00	0.15
291	000887	中鼎股份	24,700	302,328.00	0.15
292	002203	海亮股份	37,400	298,452.00	0.15
293	603379	三美股份	7,600	297,464.00	0.15
294	002831	裕同科技	11,600	296,844.00	0.15
295	603225	新凤鸣	19,000	296,210.00	0.15

296	600755	厦门国贸	41,300	296,121.00	0.15
297	688390	固德威	5,205	292,104.60	0.15
298	600859	王府井	24,800	291,152.00	0.15
299	688521	芯原股份	10,881	291,066.75	0.15
300	601880	辽港股份	235,100	289,173.00	0.15
301	600995	南网储能	29,900	288,834.00	0.15
302	600801	华新水泥	21,000	288,750.00	0.15
303	600329	达仁堂	8,900	288,271.00	0.15
304	600416	湘电股份	29,000	288,260.00	0.15
305	600884	杉杉股份	35,300	286,636.00	0.15
306	002683	广东宏大	14,200	285,846.00	0.15
307	300070	碧水源	67,900	284,501.00	0.15
308	300296	利亚德	63,200	284,400.00	0.15
309	600390	五矿资本	70,200	284,310.00	0.15
310	002019	亿帆医药	23,000	284,280.00	0.15
311	002506	协鑫集成	146,100	283,434.00	0.14
312	600435	北方导航	32,800	282,736.00	0.14
313	002244	滨江集团	38,900	282,414.00	0.14
314	600483	福能股份	24,000	279,840.00	0.14
315	600739	辽宁成大	33,400	279,558.00	0.14
316	000050	深天马 A	38,400	279,552.00	0.14
317	300748	金力永磁	21,480	278,380.80	0.14
318	601098	中南传媒	22,400	278,208.00	0.14
319	600399	抚顺特钢	49,300	277,559.00	0.14
320	600598	北大荒	22,200	277,278.00	0.14
321	601598	中国外运	49,200	276,996.00	0.14
322	300803	指南针	7,600	276,716.00	0.14
323	002568	百润股份	16,400	276,012.00	0.14
324	002572	索菲亚	18,000	275,940.00	0.14
325	600901	江苏金租	54,540	275,427.00	0.14
326	000155	川能动力	25,400	273,558.00	0.14

327	300676	华大基因	7,800	273,078.00	0.14
328	600848	上海临港	29,900	272,389.00	0.14
329	002487	大金重工	11,900	272,272.00	0.14
330	002080	中材科技	21,000	270,900.00	0.14
331	001286	陕西能源	23,400	269,802.00	0.14
332	002240	盛新锂能	20,100	269,742.00	0.14
333	002373	千方科技	29,600	268,472.00	0.14
334	002557	洽洽食品	9,500	267,805.00	0.14
335	002936	郑州银行	154,579	267,421.67	0.14
336	603712	七一二	14,500	263,755.00	0.13
337	000563	陕国投 A	95,843	263,568.25	0.13
338	300595	欧普康视	16,800	263,424.00	0.13
339	002268	电科网安	18,500	263,255.00	0.13
340	603858	步长制药	17,300	262,095.00	0.13
341	600968	海油发展	63,500	261,620.00	0.13
342	601928	凤凰传媒	23,800	260,848.00	0.13
343	603883	老百姓	14,196	260,638.56	0.13
344	000778	新兴铸管	74,700	259,956.00	0.13
345	600258	首旅酒店	20,939	258,596.65	0.13
346	688017	绿的谐波	3,147	258,368.70	0.13
347	601212	白银有色	92,500	257,150.00	0.13
348	688538	和辉光电	129,782	256,968.36	0.13
349	688301	奕瑞科技	2,222	256,041.06	0.13
350	600271	航天信息	34,700	255,392.00	0.13
351	688234	天岳先进	5,443	255,385.56	0.13
352	600062	华润双鹤	13,000	254,540.00	0.13
353	600528	中铁工业	34,700	254,004.00	0.13
354	300558	贝达药业	7,800	253,890.00	0.13
355	603688	石英股份	8,500	251,685.00	0.13
356	688536	思瑞浦	2,570	251,371.70	0.13
357	600977	中国电影	23,300	250,708.00	0.13

358	000709	河钢股份	129,060	250,376.40	0.13
359	002531	天顺风能	28,000	250,320.00	0.13
360	601155	新城控股	28,200	250,134.00	0.13
361	000739	普洛药业	18,300	248,331.00	0.13
362	002408	齐翔腾达	44,340	248,304.00	0.13
363	600959	江苏有线	93,700	247,368.00	0.13
364	600378	昊华科技	8,500	245,650.00	0.13
365	688005	容百科技	10,539	245,347.92	0.13
366	688220	翱捷科技	6,503	243,602.38	0.12
367	601118	海南橡胶	53,400	242,970.00	0.12
368	688331	荣昌生物	5,622	242,870.40	0.12
369	000825	太钢不锈	71,400	241,332.00	0.12
370	603737	三棵树	6,600	239,382.00	0.12
371	603882	金域医学	8,800	239,272.00	0.12
372	600056	中国医药	23,320	235,998.40	0.12
373	000987	越秀资本	46,940	232,822.40	0.12
374	600612	老凤祥	4,000	232,760.00	0.12
375	601399	国机重装	90,100	232,458.00	0.12
376	600517	国网英大	53,600	232,088.00	0.12
377	600906	财达证券	40,500	232,065.00	0.12
378	603444	吉比特	1,300	231,413.00	0.12
379	603456	九洲药业	16,800	230,496.00	0.12
380	601019	山东出版	19,500	230,490.00	0.12
381	688200	华峰测控	2,498	229,191.50	0.12
382	002266	浙富控股	81,500	227,385.00	0.12
383	300212	易华录	13,500	227,205.00	0.12
384	600316	洪都航空	13,400	222,842.00	0.11
385	000937	冀中能源	33,100	221,770.00	0.11
386	603650	彤程新材	7,500	221,625.00	0.11
387	603529	爱玛科技	8,100	221,373.00	0.11
388	600871	石化油服	127,100	221,154.00	0.11

389	688567	孚能科技	22,800	218,880.00	0.11
390	600925	苏能股份	43,000	217,150.00	0.11
391	002423	中粮资本	28,800	215,712.00	0.11
392	000032	深桑达 A	14,200	212,716.00	0.11
393	688063	派能科技	5,352	212,527.92	0.11
394	001227	兰州银行	88,900	211,582.00	0.11
395	601965	中国汽研	12,500	211,125.00	0.11
396	600098	广州发展	32,800	209,920.00	0.11
397	600208	新潮中宝	132,800	209,824.00	0.11
398	601298	青岛港	21,900	209,364.00	0.11
399	688516	奥特维	5,004	209,217.24	0.11
400	603728	鸣志电器	5,200	209,196.00	0.11
401	688297	中无人机	6,296	207,956.88	0.11
402	601608	中信重工	54,200	206,502.00	0.11
403	002607	中公教育	134,800	206,244.00	0.11
404	002670	国盛金控	24,200	204,974.00	0.10
405	600663	陆家嘴	23,200	204,624.00	0.10
406	600022	山东钢铁	167,000	203,740.00	0.10
407	603233	大参林	14,220	203,346.00	0.10
408	600578	京能电力	62,700	203,148.00	0.10
409	300438	鹏辉能源	11,000	201,740.00	0.10
410	688561	奇安信	8,522	201,289.64	0.10
411	300357	我武生物	9,806	198,277.32	0.10
412	601106	中国一重	85,600	197,736.00	0.10
413	300776	帝尔激光	4,280	196,708.80	0.10
414	600500	中化国际	56,000	195,440.00	0.10
415	600377	宁沪高速	15,500	195,300.00	0.10
416	003031	中瓷电子	4,200	194,208.00	0.10
417	002865	钧达股份	5,000	191,900.00	0.10
418	600967	内蒙一机	26,600	191,520.00	0.10
419	000785	居然之家	78,500	190,755.00	0.10

420	600315	上海家化	10,600	188,468.00	0.10
421	600350	山东高速	21,200	187,620.00	0.10
422	688349	三一重能	7,534	187,144.56	0.10
423	300888	稳健医疗	7,340	185,702.00	0.09
424	000537	中绿电	19,400	184,882.00	0.09
425	600827	百联股份	25,000	184,500.00	0.09
426	000958	电投产融	50,400	184,464.00	0.09
427	000559	万向钱潮	41,300	184,198.00	0.09
428	601568	北元集团	49,560	183,867.60	0.09
429	688425	铁建重工	49,953	183,827.04	0.09
430	002608	江苏国信	23,600	182,900.00	0.09
431	002690	美亚光电	11,010	181,665.00	0.09
432	000156	华数传媒	28,900	181,492.00	0.09
433	603707	健友股份	15,169	180,207.72	0.09
434	603517	绝味食品	11,600	178,640.00	0.09
435	603826	坤彩科技	6,160	178,455.20	0.09
436	601992	金隅集团	130,200	178,374.00	0.09
437	002867	周大生	13,650	178,269.00	0.09
438	688029	南微医学	2,884	177,539.04	0.09
439	688032	禾迈股份	1,544	177,220.32	0.09
440	600126	杭钢股份	42,200	173,442.00	0.09
441	300682	朗新集团	20,300	172,753.00	0.09
442	003022	联泓新科	12,500	171,375.00	0.09
443	000967	盈峰环境	39,700	167,931.00	0.09
444	688475	萤石网络	4,897	167,036.67	0.09
445	688778	厦钨新能	5,326	166,384.24	0.08
446	603218	日月股份	16,100	165,347.00	0.08
447	688520	神州细胞	4,186	164,719.10	0.08
448	600032	浙江新能	22,500	163,800.00	0.08
449	301267	华夏眼科	7,900	163,688.00	0.08
450	600361	创新新材	40,600	163,618.00	0.08

451	600481	双良节能	35,000	163,450.00	0.08
452	600339	中油工程	52,300	163,176.00	0.08
453	603786	科博达	2,500	160,375.00	0.08
454	600095	湘财股份	26,800	159,728.00	0.08
455	000898	鞍钢股份	74,700	158,364.00	0.08
456	603127	昭衍新药	11,836	157,063.72	0.08
457	003035	南网能源	35,500	156,200.00	0.08
458	688248	南网科技	5,268	156,090.84	0.08
459	600808	马钢股份	75,100	151,702.00	0.08
460	002563	森马服饰	25,200	146,412.00	0.07
461	002153	石基信息	25,544	146,367.12	0.07
462	688281	华秦科技	1,749	145,726.68	0.07
463	603185	弘元绿能	8,500	145,265.00	0.07
464	601228	广州港	47,100	143,655.00	0.07
465	000539	粤电力A	27,800	141,224.00	0.07
466	688779	长远锂科	30,193	139,793.59	0.07
467	001872	招商港口	7,200	138,600.00	0.07
468	600928	西安银行	41,600	136,032.00	0.07
469	001203	大中矿业	14,100	135,501.00	0.07
470	000401	冀东水泥	33,200	134,792.00	0.07
471	000959	首钢股份	48,700	132,464.00	0.07
472	688006	杭可科技	7,546	131,677.70	0.07
473	600764	中国海防	6,700	131,521.00	0.07
474	002518	科士达	7,300	129,210.00	0.07
475	603056	德邦股份	9,600	125,760.00	0.06
476	603305	旭升集团	11,700	123,552.00	0.06
477	600299	安迪苏	12,600	122,220.00	0.06
478	688172	燕东微	7,457	120,654.26	0.06
479	601139	深圳燃气	18,000	120,240.00	0.06
480	300861	美畅股份	6,000	116,100.00	0.06
481	603317	天味食品	10,008	114,191.28	0.06

482	688276	百克生物	3,866	109,678.42	0.06
483	688387	信科移动	21,260	107,150.40	0.05
484	301029	怡合达	5,400	106,164.00	0.05
485	688375	国博电子	1,493	105,465.52	0.05
486	002791	坚朗五金	4,000	103,480.00	0.05
487	688819	天能股份	4,268	101,834.48	0.05
488	600927	永安期货	9,100	101,465.00	0.05
489	688153	唯捷创芯	2,601	96,237.00	0.05
490	688107	安路科技	3,739	95,045.38	0.05
491	000031	大悦城	40,100	93,834.00	0.05
492	601858	中国科传	4,900	93,688.00	0.05
493	601158	重庆水务	18,000	86,400.00	0.04
494	601828	美凯龙	33,800	86,190.00	0.04
495	688348	昱能科技	1,451	85,609.00	0.04
496	002945	华林证券	8,400	83,832.00	0.04
497	600956	新天绿能	9,600	78,432.00	0.04
498	301165	锐捷网络	2,100	62,664.00	0.03
499	688295	中复神鹰	3,078	62,483.40	0.03
500	603868	飞科电器	1,500	57,600.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002146	荣盛发展	66,900	99,681.00	0.05
2	688237	超卓航科	2,402	48,160.10	0.02
3	688171	纬德信息	2,821	42,540.68	0.02
4	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
5	603285	键邦股份	1,029	19,190.85	0.01
6	688692	达梦数据	77	13,469.61	0.01



7	301538	骏鼎达	145	13,229.80	0.01
8	300953	震裕科技	240	13,008.00	0.01
9	301015	百洋医药	462	10,870.86	0.01
10	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.01
11	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
12	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
13	301580	C爱迪特	129	8,504.97	0.00
14	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
15	688709	成都华微	408	7,666.32	0.00
16	301048	金鹰重工	843	6,996.90	0.00
17	301587	中瑞股份	266	6,719.16	0.00
18	603605	珀莱雅	60	6,659.40	0.00
19	001389	广合科技	176	6,082.56	0.00
20	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
21	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
22	601033	永兴股份	303	4,835.88	0.00
23	301016	雷尔伟	275	4,628.25	0.00
24	300971	博亚精工	245	4,574.15	0.00
25	603341	龙旗科技	116	4,348.84	0.00
26	301033	迈普医学	108	4,223.88	0.00
27	301007	德迈仕	303	3,539.04	0.00
28	001359	平安电工	141	2,904.60	0.00
29	603344	星德胜	123	2,787.18	0.00
30	603082	北自科技	94	2,772.06	0.00
31	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
32	301057	汇隆新材	218	2,493.92	0.00
33	603375	盛景微	60	2,334.00	0.00
34	603381	C永臻	90	2,261.70	0.00
35	603325	博隆技术	33	2,245.98	0.00
36	001379	腾达科技	165	2,224.20	0.00
37	603613	国联股份	109	2,137.49	0.00

38	603312	西典新能	81	2,054.16	0.00
39	002603	以岭药业	55	843.15	0.00
40	600717	天津港	80	341.60	0.00
41	600064	南京高科	23	139.61	0.00
42	000990	诚志股份	6	44.64	0.00
43	600120	浙江东方	10	33.40	0.00
44	600522	中天科技	1	15.85	0.00
45	600376	首开股份	3	6.30	0.00
46	400174	中天3	154,400	-	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688777	中控技术	874,650.56	0.40
2	601567	三星医疗	756,192.00	0.34
3	000009	中国宝安	701,349.00	0.32
4	688617	惠泰医疗	655,272.42	0.30
5	002202	金风科技	641,766.00	0.29
6	603979	金诚信	600,054.00	0.27
7	301358	湖南裕能	593,113.00	0.27
8	601615	明阳智能	591,253.00	0.27
9	002436	兴森科技	575,241.00	0.26
10	300002	神州泰岳	571,277.00	0.26
11	000921	海信家电	556,809.00	0.25
12	300054	鼎龙股份	541,658.00	0.25
13	600872	中炬高新	522,906.00	0.24
14	603345	安井食品	517,061.00	0.24
15	002984	森麒麟	485,499.00	0.22

16	603179	新泉股份	455,450.00	0.21
17	688525	佰维存储	452,225.03	0.21
18	603087	甘李药业	447,635.00	0.20
19	000818	航锦科技	431,831.00	0.20
20	688065	凯赛生物	425,358.97	0.19

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002463	沪电股份	1,637,727.00	0.75
2	002422	科伦药业	1,468,867.00	0.67
3	000975	银泰黄金	1,191,787.00	0.54
4	600160	巨化股份	1,087,885.00	0.50
5	300418	昆仑万维	1,080,903.00	0.49
6	600161	天坛生物	946,469.00	0.43
7	600415	小商品城	835,648.00	0.38
8	688072	拓荆科技	772,570.48	0.35
9	600482	中国动力	749,360.00	0.34
10	000009	中国宝安	730,171.00	0.33
11	002600	领益智造	531,691.00	0.24
12	688728	格科微	393,720.97	0.18
13	002131	利欧股份	374,680.00	0.17
14	300394	天孚通信	364,751.00	0.17
15	002032	苏泊尔	327,464.00	0.15
16	601168	西部矿业	316,516.00	0.14
17	000581	威孚高科	314,033.00	0.14
18	002966	苏州银行	310,999.00	0.14
19	000547	航天发展	307,550.00	0.14

20	002092	ST中泰	307,340.00	0.14
----	--------	------	------------	------

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	50,775,477.62
卖出股票收入（成交）总额	56,252,822.99

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	15,598.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	207,036.79
6	其他应收款	9,035.96
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	231,670.95

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000988	华工科技	374,125.00	0.19	转融通证券出借

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	--------------	----------

1	603350	安乃达	21,608.56	0.01	新股未上市
2	603285	键邦股份	19,190.85	0.01	新股未上市

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 58 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东财中证500A	8,756	16,961.24	17,788,127.15	11.98%	130,724,510.48	88.02%
东财中证500C	4,593	15,694.43	19,751,678.00	27.40%	52,332,851.30	72.60%
合计	12,748	17,304.45	37,539,805.15	17.02%	183,057,361.78	82.98%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东财中证500A	30,925.37	0.02%
	东财中证500C	36.73	0.00%
	合计	30,962.10	0.01%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 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

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固 有资金	10,899,819.83	4.94%	10,000,458.38	4.53%	3年
基金管理人高 级管理人员	30,897.51	0.01%	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	6,534,957.42	2.96%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	17,465,674.76	7.92%	10,000,458.38	4.53%	3年

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	东财中证500A	东财中证500C
基金合同生效日(2021年01月20 日)基金份额总额	266,643,478.48	138,576,371.83
本报告期期初基金份额总额	153,874,609.62	76,085,928.22

本报告期基金总申购份额	16,806,409.35	41,059,704.65
减：本报告期基金总赎回份额	22,168,381.34	45,061,103.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	148,512,637.63	72,084,529.30

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：自2024年3月23日起，吴逸、倪永彪担任西藏东财基金管理有限公司（以下简称“东财基金”）总经理助理；2024年4月19日，东财基金上海分公司负责人变更为沙福贵；2024年4月20日，东财基金副总经理荀航因个人原因离职。

基金托管人：本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生重大改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况



金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东财证券	4	106,168,689.35	100.00%	100,511.43	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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2023年第4季度报告	证监会规定网站	2024-01-22
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	2024-01-31
3	西藏东财中证500指数型发	证监会规定网站	2024-03-30

	起式证券投资基金2023年年度报告		
4	西藏东财基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告	证监会规定网站及报刊	2024-04-19
5	西藏东财基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2024-04-20
6	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2024年第1季度报告	证监会规定网站	2024-04-22
7	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金更新招募说明书（2024年第1号）	证监会规定网站	2024-06-28
8	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	2024-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

## 七、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

西藏东财基金管理有限公司  
二〇二四年八月二十九日