

# 西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:西藏东财基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2022年03月25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2021年01月01日起至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	69
8.1 期末基金资产组合情况	69
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	70
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	72
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	80
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	80
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	80
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	80
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	80

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	80
8.12 投资组合报告附注.....	80
§9 基金份额持有人信息.....	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	83
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	83
§10 开放式基金份额变动.....	83
§11 重大事件揭示.....	84
11.1 基金份额持有人大会决议.....	84
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.....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
11.4 基金投资策略的改变.....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	84
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
11.8 其他重大事件.....	85
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
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.....	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
§13 备查文件目录.....	88
13.1 备查文件目录.....	88
13.2 存放地点.....	89
13.3 查阅方式.....	89

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金	
基金简称	东财创业板	
基金主代码	009046	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年03月18日	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	123,073,535.78份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财创业板A	东财创业板C
下属分级基金的交易代码	009046	009047
报告期末下属分级基金的份额总额	85,740,258.46份	37,333,277.32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。
业绩比较基准	创业板指数收益率×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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	沙福贵	龚小武
	联系电话	021-23526999	021-52629999-212056
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400-9210-107	95561
传真		021-23526940	021-62159217
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	福州市湖东路154号
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号 金座5楼	上海市银城路167号兴业大厦 4楼
邮政编码		200030	200120
法定代表人		戴彦	吕家进

### 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	西藏东财基金管理有限公司	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2021年		2020年03月18日（基金合同生效日）-2020年 12月31日	
	东财创业板A	东财创业板 C	东财创业板A	东财创业板C
本期已 实现收 益	38,878,597. 72	16,605,95 3.95	34,175,543.55	16,353,254.26
本期利 润	25,871,514. 10	12,858,88 7.97	80,556,405.22	38,342,888.22
加权平 均基金 份额本 期利润	0.2706	0.3109	0.5711	0.5534
本期加 权平均 净值利 润率	15.52%	17.91%	43.65%	42.20%
本期基 金份额 净值增 长率	16.02%	15.73%	59.45%	59.14%
3.1.2 期末数 据和指 标	2021年末		2020年末	
期末可 供分配 利润	56,433,615. 80	24,254,55 6.27	28,476,517.41	13,539,319.10
期末可 供分配	0.6582	0.6497	0.2530	0.2501

基金份 额利润				
期末基 金资产 净值	158,622,15 2.71	68,760,24 9.81	179,448,167.05	86,135,587.69
期末基 金份额 净值	1.8500	1.8418	1.5945	1.5914
<b>3.1.3 累计期 末指标</b>	2021年末		2020年末	
基金份 额累计 净值增 长率	85.00%	84.18%	59.45%	59.14%

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

东财创业板A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	3.02%	1.04%	2.30%	1.05%	0.72%	-0.01%
过去六个月	-2.43%	1.46%	-4.15%	1.46%	1.72%	0.00%
过去一年	16.02%	1.67%	11.59%	1.66%	4.43%	0.01%

自基金合同生效起至今	85.00%	1.67%	69.15%	1.67%	15.85%	0.00%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

## 东财创业板C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.96%	1.04%	2.30%	1.05%	0.66%	-0.01%
过去六个月	-2.55%	1.46%	-4.15%	1.46%	1.60%	0.00%
过去一年	15.73%	1.67%	11.59%	1.66%	4.14%	0.01%
自基金合同生效起至今	84.18%	1.67%	69.15%	1.67%	15.03%	0.00%

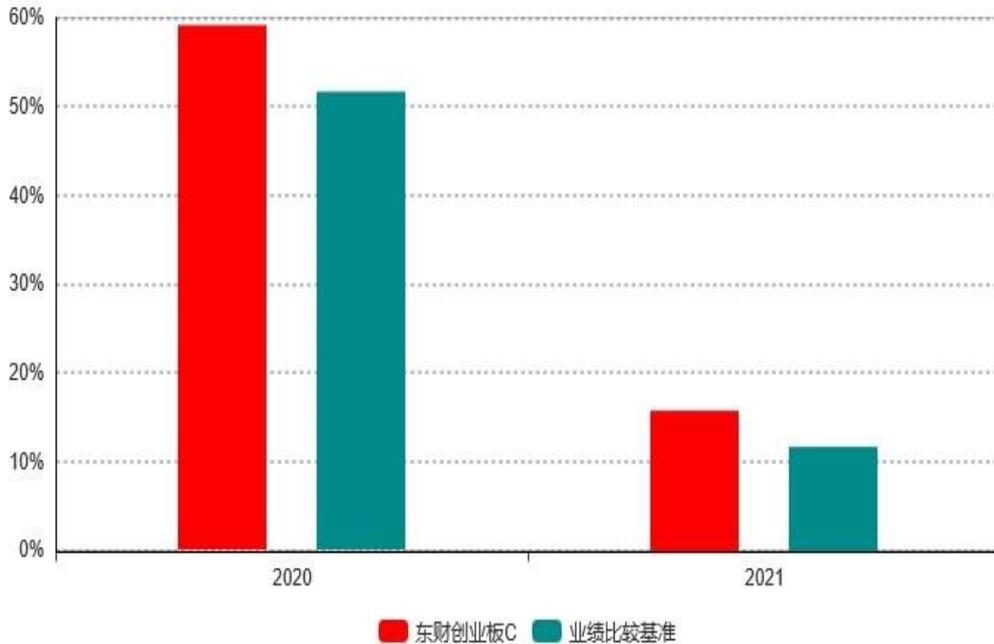
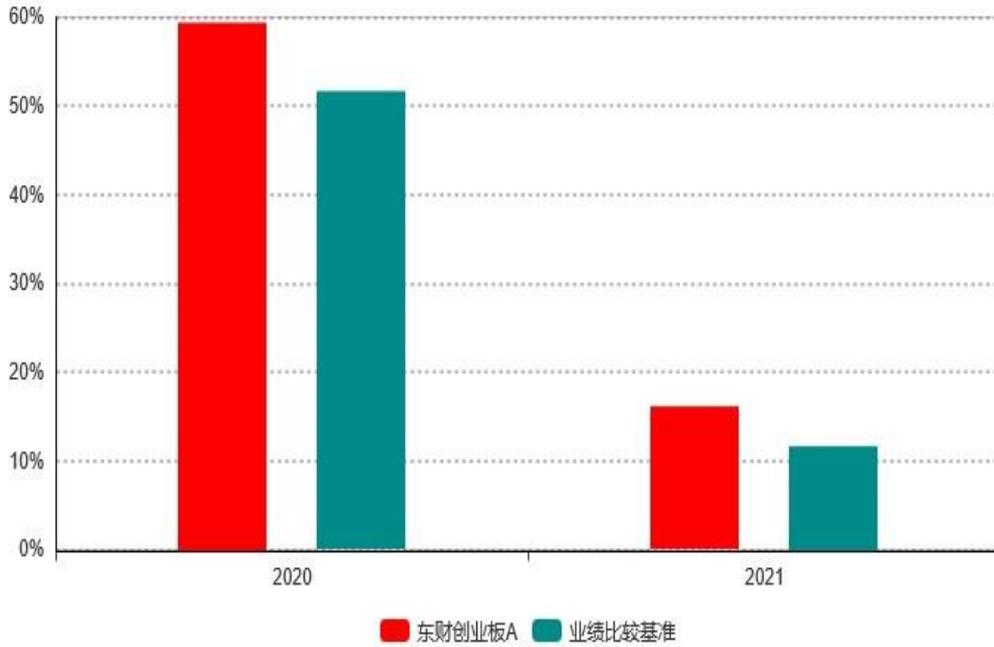
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：1、本基金基金合同于 2020 年 3 月 18 日生效。  
2、本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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



注：本基金基金合同于 2020 年 3 月 18 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2020年3月18日生效，自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2021年12月31日，公司旗下管理22只证券投资基金--西藏东财上证50指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财信息产业精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金、西藏东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证云计算与大数据主题指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财创新医疗六个月定期开放混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证芯片产业指数型发起式证券投资基金、西藏东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证食品饮料指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深创新药产业指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证新能源指数增强型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

吴逸	本基金基金经理、西藏东财上证50指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财信息产业精选混合型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证沪港深创新药产业指数型发起式证券投资基金的基金经理、量化投资部总监、研究部总监	2020-03-18	-	1 1. 5 年	上海财经大学经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。自2010年6月开始，先后在天治基金管理有限公司、东方财富信息股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、西藏东财基金管理有限公司筹备组、西藏东财基金管理有限公司担任产品创新及量化投资部总监助理、筹备组成员、资产管理总部投资主办人、量化投资部总监、研究部总监等职务。
姚楠燕	本基金基金经理、西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证有色金属指数增强型	2020-03-18	-	4. 5 年	复旦大学经济学学士学位，美国南加利福尼亚大学公共政策硕士学位。自2013年8月始，先后在中欧国际工商学院、西藏东财基金管理有限公司筹备组、西藏东财基金管理有

	<p>发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证芯片产业指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证沪港深创新药产业指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证新能源指数增强型证券投资基金的基金经理、西藏东财上证50指数型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财量化精选混合型发起式证</p>			<p>限公司担任金融学/会计学 research 助理、筹备组成员、投资助理、基金经理助理兼研究员等职务。</p>
--	---	--	--	---

	券投资基金的基金经理助理、西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财信息产业精选混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、研究员				
--	--	--	--	--	--

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》等相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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内的公平交易程序，并严格按照价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的原则执行交易指令，确保交易执行的公平性。

行为监控方面，建立了有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，并建立相关记录制度，确保公平交易可稽核；对交易价格的公允性进行审查，相关投资组合经理对

交易价格异常情况进行合理性解释；在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）对不同投资组合的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控和分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易行为进行监督检查，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金在运作过程中严格遵守法律法规和基金合同的要求，对基金采取完全被动复制的方式跟踪指数，控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差，力争获取与标的指数相似的投资收益。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是基金费用、申购赎回、交易成本、网下新股申购等因素。当申赎变动、成份股调整、成份股停牌等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，保持基金整体运行平稳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年12月31日，东财创业板A份额净值为1.8500元，报告期内基金份额净值增长率为16.02%，东财创业板C份额净值为1.8418元，报告期内基金份额净值增长率为15.73%，同期业绩比较基准收益率为11.59%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，2021年，伴随多重冲击交织，中国经济下行压力加大，但全年仍实现8.1%的经济增长，彰显了巨大的发展活力和韧性。展望2022年，中国经济增速可能呈现“前低后稳”格局，当下仍面临出口趋缓、地产下行、消费低迷等压力，基建投资有望发挥托底作用。

政策方面，“稳增长”成为2022年政策的主基调。中央经济工作会议提出“稳字当头、稳中求进”，着重强调“以经济建设为中心”，说明政策层面已经做了比较充分的准备。货币政策大概率会根据经济运行灵活微调，仍具备进一步降准降息的空间，此外普惠金融亦会进一步加力。需要指出的是，国外美联储货币正常化加速，中美货币政策背离风险需警惕。财政政策方面，财政政策前置发力，资金较为充裕，1.46万亿元2022年新增专项债务限额已提前下达各地，新老基建并重。

市场方面，2022年A股市场机遇与挑战并存。上半年，政策重心在稳增长，聚焦优质蓝筹崛起；下半年，政策预计回归常态，相对更关注景气回升的板块。

#### 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与风险事件；四是执行基金运作过程中的临时公告、定期报告、招募说明书更新等相关信息披露工作；五是采取事前、事中和事后三阶段的防范控制工作，从投资决策、研究支持、交易执行、投资监督与风险管理、关联交易管理、公平交易与异常交易监控、内幕交易防控等各方面持续加强对于投资管理业务的内部控制，保障基金投资运作合法合规；六是对基金运作过程中的营销与销售、会计核算估值、信息技术支持等方面进行内部控制与合规管理；七是通过独立开展定期或不定期内部审计，监督检查各业务条线相关内部控制措施设计的合理性以及执行的有效性，针对发现的问题相应提出改进建议并督促相关业务部门及时落实改进措施；八是重视反洗钱各项工作，包括制度建

设、系统功能优化、宣传培训、日常监测等方面，积极采取有效的防范措施控制洗钱的风险。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

报告期内，本基金未发生相关预警情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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（22）第P00330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	西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则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创业板指数型发起式证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适

	当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>西藏东财基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金2021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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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创业板指数型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金、终止经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创业板指数型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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</p>

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做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，就可能对西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴凌志、孔维婷
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号21楼
审计报告日期	2022-03-18

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	12,754,157.80	18,251,296.51
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	215,275,324.79	253,190,103.49
其中：股票投资		215,275,324.79	253,190,103.49
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,199.05	2,683.33
应收股利		-	-
应收申购款		52,592.60	920,633.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		228,085,274.24	272,364,717.17
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		401,005.39	6,489,716.14
应付管理人报酬		96,909.49	116,364.98
应付托管费		9,690.94	11,636.48
应付销售服务费		14,205.87	19,458.76
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		1,272.27	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,787.76	143,786.07
负债合计		702,871.72	6,780,962.43
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	123,073,535.78	166,670,723.16
未分配利润	7.4.7.10	104,308,866.74	98,913,031.58
所有者权益合计		227,382,402.52	265,583,754.74
负债和所有者权益总计		228,085,274.24	272,364,717.17

注：报告截止日2021年12月31日，东财创业板A基金份额净值人民币1.8500元，基金份额总额85,740,258.46份；东财创业板C基金份额净值人民币1.8418元，基金份额总额37,333,277.32份。基金份额总额合计为123,073,535.78份。

## 7.2 利润表

会计主体：西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金 合同生效日）至2020年 12月31日
一、收入		40,760,140.28	120,936,909.25
1. 利息收入		593,027.95	94,062.26
其中：存款利息收入	7.4.7.11	62,651.53	94,062.26
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
证券出借利息收入		530,376.42	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		56,830,429.43	52,279,887.31
其中：股票投资收益	7.4.7.12	56,057,142.38	50,936,805.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	773,287.05	1,343,081.99
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	-16,754,149.60	68,370,495.63
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.18	90,832.50	192,464.05

<b>减：二、费用</b>		2,029,738.21	2,037,615.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,195,654.77	1,081,749.79
2. 托管费	7.4.10.2.2	119,565.44	108,174.97
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	180,059.41	178,512.14
4. 交易费用	7.4.7.19	334,239.48	506,721.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,909.54	-
7. 其他费用	7.4.7.20	198,309.57	162,457.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		38,730,402.07	118,899,293.44
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		38,730,402.07	118,899,293.44

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	166,670,723.16	98,913,031.58	265,583,754.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,730,402.07	38,730,402.07

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-43,597,187.38	-33,334,566.91	-76,931,754.29
其中：1. 基金申购款	171,936,951.89	125,050,822.31	296,987,774.20
2. 基金赎回款	-215,534,139.27	-158,385,389.22	-373,919,528.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	123,073,535.78	104,308,866.74	227,382,402.52
项 目	上年度可比期间		
	2020年03月18日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	253,171,131.13	-	253,171,131.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	118,899,293.44	118,899,293.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-86,500,407.97	-19,986,261.86	-106,486,669.83
其中：1. 基金申购款	326,074,169.17	113,243,400.15	439,317,569.32
2. 基金赎回	-412,574,577.14	-133,229,662.01	-545,804,239.15

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	166,670,723.16	98,913,031.58	265,583,754.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

沙福贵

侯福岩

陆文澄

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

西藏东财创业板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《西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财创业板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]211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253,171,131.13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（20）第00014号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2020年3月18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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产比例不得低于基金资产净值的90%；投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：创业板指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。上年度可比期间为2020年3月18日（基金合同生效日）至2020年12月31日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金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贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

##### (2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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，贷款及应收款项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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，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，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。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根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次

输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准

金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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。

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在转融通证券实际出借期间内，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时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的差额确认。

债券投资收益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与应收利息（若有）后的差额确认。

资产支持证券投资收益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与应收利息（若有）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后的差额确认。

股利收入于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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率逐日计提。

东财创业板A基金份额不收取销售服务费；东财创业板C基金份额的销售服务费按前一日该类别基金资产净值的0.25%年费率逐日计提。

本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

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

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈

证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

（2）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（3）根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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]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]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	6,019,026.92	6,272,571.58
定期存款	-	-
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	6,735,130.88	11,978,724.93
合计	12,754,157.80	18,251,296.51

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	163,658,978.76	215,275,324.79	51,616,346.03

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		163,658,978.76	215,275,324.79	51,616,346.03
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		184,819,607.86	253,190,103.49	68,370,495.63
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		184,819,607.86	253,190,103.49	68,370,495.63

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	646.43	971.06
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	1,080.65	1,712.27
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	1,471.97	-
其他	-	-
合计	3,199.05	2,683.33

## 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产余额。

## 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用余额。

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	66.10	384.37
应付证券出借违约金	-	-
预提费用-审计费	24,000.00	24,000.00

预提费用-信息披露费	120,000.00	90,000.00
其他应付	35,721.66	29,401.70
合计	179,787.76	143,786.07

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 东财创业板A

金额单位：人民币元

项目 (东财创业板A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	112,543,480.95	112,543,480.95
本期申购	89,889,513.37	89,889,513.37
本期赎回(以“-”号填列)	-116,692,735.86	-116,692,735.86
本期末	85,740,258.46	85,740,258.46

##### 7.4.7.9.2 东财创业板C

金额单位：人民币元

项目 (东财创业板C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	54,127,242.21	54,127,242.21
本期申购	82,047,438.52	82,047,438.52
本期赎回(以“-”号填列)	-98,841,403.41	-98,841,403.41
本期末	37,333,277.32	37,333,277.32

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 东财创业板A

单位：人民币元

项目 (东财创业板A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,476,517.41	38,428,168.69	66,904,686.10

本期利润	38,878,597.72	-13,007,083.62	25,871,514.10
本期基金份额交易产生的变动数	-10,921,499.33	-8,972,806.62	-19,894,305.95
其中：基金申购款	39,045,010.92	27,261,318.77	66,306,329.69
基金赎回款	-49,966,510.25	-36,234,125.39	-86,200,635.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,433,615.80	16,448,278.45	72,881,894.25

## 7.4.7.10.2 东财创业板C

单位：人民币元

项目 (东财创业板C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,539,319.10	18,469,026.38	32,008,345.48
本期利润	16,605,953.95	-3,747,065.98	12,858,887.97
本期基金份额交易产生的变动数	-5,890,716.78	-7,549,544.18	-13,440,260.96
其中：基金申购款	35,928,277.42	22,816,215.20	58,744,492.62
基金赎回款	-41,818,994.20	-30,365,759.38	-72,184,753.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,254,556.27	7,172,416.22	31,426,972.49

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年03月18日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	25,430.56	57,506.14
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	37,220.97	36,556.12
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	62,651.53	94,062.26

## 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	203,142,989.63	271,397,495.04
减：卖出股票成本总额	147,085,847.25	220,460,689.72
买卖股票差价收入	56,057,142.38	50,936,805.32

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

## 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	773,287.05	1,343,081.99
其中：证券出借权益补偿收入	49,750.33	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	773,287.05	1,343,081.99

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年03月18日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-16,754,149.60	68,370,495.63
——股票投资	-16,754,149.60	68,370,495.63
——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	-16,754,149.60	68,370,495.63

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年03月18日(基金合同生效 日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	76,777.61	188,668.99
转换费收入	14,054.89	3,795.06
合计	90,832.50	192,464.05

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。  
2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	334,239.48	506,721.22
银行间市场交易费用	-	-
合计	334,239.48	506,721.22

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	24,000.00	24,000.00
信息披露费	120,000.00	90,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	6,483.39	4,787.68
指数使用费	47,826.18	43,270.01
开户费	-	400.00
合计	198,309.57	162,457.69

#### 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

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
西藏东财基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方财富证券股份有限公司（“东财”	基金管理人的股东、基金销售机构

证券”)	
上海天天基金销售有限公司 (“天天基金”)	与管理人受同一实际控制人控制的公司、基金销售机构

注：本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化；下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

###### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生应付关联方佣金。

##### 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 2021年01月01日 至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同 生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,195,654.77	1,081,749.79
其中：支付销售机构的客户维护费	548,405.86	506,401.30

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年03月18日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	119,565.44	108,174.97

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财创业板A	东财创业板C	合计
天天基金	0.00	153,975.28	153,975.28
东财证券	0.00	17,953.42	17,953.42
兴业银行	0.00	1,783.93	1,783.93
合计	0.00	173,712.63	173,712.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年03月18日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财创业板A	东财创业板C	合计
天天基金	0.00	150,273.34	150,273.34
东财证券	0.00	18,918.14	18,918.14

兴业银行	0.00	616.73	616.73
合计	0.00	169,808.21	169,808.21

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0.25%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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 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

单位：人民币元

本期										
2021年01月01日至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(股)	出借期限(天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东财证券	2021042300000656	迈克生物	2021-04-23	117,666.00	2,700	14	3.30%	151.00	-	-
东财证券	2021042300000658	万孚生物	2021-04-23	127,504.00	1,300	14	3.30%	163.63	-	-
东财证券	20210428000005	卓胜微	2021-04-28	1,588,776.00	2,100	14	3.80%	2,347.86	-	-

	95									
东财证 券	2021042 8000005 97	中际旭 创	2021-04 -28	347,32 2.00	10,700	14	3.80%	513.26	-	-
东财证 券	2021042 8000005 99	智飞生 物	2021-04 -28	2,856,0 62.00	13,100	14	3.80%	4,220.6 2	-	-
东财证 券	2021042 8000006 03	信维通 信	2021-04 -28	488,07 0.00	17,400	14	3.80%	721.26	-	-
东财证 券	2021042 8000006 05	我武生 物	2021-04 -28	412,50 9.00	5,700	14	3.80%	609.60	-	-
东财证 券	2021042 8000006 07	万孚生 物	2021-04 -28	252,52 5.00	2,500	14	3.80%	373.18	-	-
东财证 券	2021042 8000006 09	华大基 因	2021-04 -28	505,63 5.00	3,900	14	3.80%	747.22	-	-
东财证 券	2021042 8000006 11	普利制 药	2021-04 -28	286,14 0.00	5,700	14	3.80%	422.85	-	-
东财证 券	2021042 8000006 13	健帆生 物	2021-04 -28	810,90 0.00	8,500	14	3.80%	1,198.3 3	-	-
东财证 券	2021042 8000006 15	康泰生 物	2021-04 -28	1,083,7 76.00	6,400	14	3.80%	1,601.5 8	-	-
东财证 券	2021042 8000006 17	迈克生 物	2021-04 -28	224,95 0.00	5,000	14	3.80%	332.43	-	-
东财证 券	2021042 8000006 19	新易盛	2021-04 -28	188,42 3.00	4,700	14	3.80%	278.45	-	-
东财证 券	2021042 8000006 21	欧普康 视	2021-04 -28	744,90 0.00	6,500	14	3.80%	1,100.8 0	-	-
东财证 券	2021042 8000006 23	迪安诊 断	2021-04 -28	362,93 4.00	9,400	14	3.80%	536.34	-	-
东财证 券	2021042 8000006 25	泰格医 药	2021-04 -28	1,758,7 90.00	11,000	14	3.80%	2,599.1 0	-	-
东财证 券	2021042 8000006 27	安科生 物	2021-04 -28	380,92 8.00	19,200	14	3.80%	562.93	-	-
东财证 券	2021042 8000006 29	乐普医 疗	2021-04 -28	812,50 0.00	25,000	14	3.80%	1,200.6 9	-	-
东财证 券	2021042 8000006 31	光环新 网	2021-04 -28	332,99 5.00	23,500	14	3.80%	492.09	-	-
东财证 券	2021042 8000006	沃森生 物	2021-04 -28	2,064,0 48.00	33,600	14	3.80%	3,050.2 0	-	-

	33									
东财证 券	2021042 8000006 35	爱尔眼 科	2021-04 -28	2,833,1 60.00	37,600	14	3.80%	4,186.7 8	-	-
东财证 券	2021042 8000006 37	红日药 业	2021-04 -28	158,42 2.00	37,900	14	3.80%	234.11	-	-
东财证 券	2021042 8000007 23	三环集 团	2021-04 -28	919,14 2.00	22,600	14	3.80%	1,358.2 9	-	-
东财证 券	2021050 7000078 16	迈克生 物	2021-05 -07	125,14 5.00	2,700	14	3.30%	160.60	-	-
东财证 券	2021050 7000078 20	万孚生 物	2021-05 -07	122,48 6.00	1,300	14	3.30%	157.19	-	-
东财证 券	2021051 2000096 75	万孚生 物	2021-05 -12	231,75 0.00	2,500	14	3.80%	342.48	-	-
东财证 券	2021051 2000096 77	华大基 因	2021-05 -12	479,31 0.00	3,900	14	3.80%	708.31	-	-
东财证 券	2021051 2000096 79	新易盛	2021-05 -12	169,99 9.00	4,700	14	3.80%	251.22	-	-
东财证 券	2021051 2000096 81	迈克生 物	2021-05 -12	236,20 0.00	5,000	14	3.80%	349.05	-	-
东财证 券	2021051 2000096 83	普利制 药	2021-05 -12	271,60 5.00	5,700	14	3.80%	401.37	-	-
东财证 券	2021051 2000096 85	我武生 物	2021-05 -12	390,84 9.00	5,700	14	3.80%	577.59	-	-
东财证 券	2021051 2000096 87	康泰生 物	2021-05 -12	1,174,6 56.00	6,400	14	3.80%	1,735.8 8	-	-
东财证 券	2021051 2000096 89	欧普康 视	2021-05 -12	799,56 5.00	6,500	14	3.80%	1,181.5 8	-	-
东财证 券	2021051 2000096 93	健帆生 物	2021-05 -12	808,35 0.00	8,500	14	3.80%	1,194.5 6	-	-
东财证 券	2021051 2000099 43	迪安诊 断	2021-05 -12	365,47 2.00	9,400	14	3.80%	540.09	-	-
东财证 券	2021051 2000099 45	中际旭 创	2021-05 -12	351,60 2.00	10,700	14	3.80%	519.59	-	-
东财证 券	2021051 2000099 47	泰格医 药	2021-05 -12	1,729,2 00.00	11,000	14	3.80%	2,555.3 7	-	-
东财证 券	2021051 2000099	智飞生 物	2021-05 -12	2,751,1 31.00	13,100	14	3.80%	4,065.5 6	-	-

	49									
东财证 券	2021051 2000099 51	信维通 信	2021-05 -12	446,48 4.00	17,400	14	3.80%	659.80	-	-
东财证 券	2021051 2000099 53	安科生 物	2021-05 -12	395,52 0.00	19,200	14	3.80%	584.49	-	-
东财证 券	2021051 2000099 55	光环新 网	2021-05 -12	337,69 5.00	23,500	14	3.80%	499.04	-	-
东财证 券	2021051 2000099 57	乐普医 疗	2021-05 -12	762,00 0.00	25,000	14	3.80%	1,126.0 7	-	-
东财证 券	2021051 2000099 59	沃森生 物	2021-05 -12	2,169,8 88.00	33,600	14	3.80%	3,206.6 1	-	-
东财证 券	2021051 2000099 61	爱尔眼 科	2021-05 -12	2,809,8 48.00	37,600	14	3.80%	4,152.3 3	-	-
东财证 券	2021051 2000099 63	红日药 业	2021-05 -12	166,00 2.00	37,900	14	3.80%	245.31	-	-
东财证 券	2021051 2000103 09	三环集 团	2021-05 -12	823,09 2.00	22,600	14	3.80%	1,216.3 5	-	-
东财证 券	2021051 2000104 63	卓胜微	2021-05 -12	791,70 0.00	2,100	14	3.80%	1,169.9 6	-	-
东财证 券	2021052 1000054 40	万孚生 物	2021-05 -21	115,89 5.00	1,300	14	3.30%	148.73	-	-
东财证 券	2021052 6000103 70	华大基 因	2021-05 -26	485,51 1.00	3,900	14	3.80%	717.48	-	-
东财证 券	2021052 6000103 72	迈克生 物	2021-05 -26	235,25 0.00	5,000	14	3.80%	347.65	-	-
东财证 券	2021052 6000103 74	普利制 药	2021-05 -26	295,83 0.00	5,700	14	3.80%	437.17	-	-
东财证 券	2021052 6000103 76	我武生 物	2021-05 -26	399,74 1.00	5,700	14	3.80%	590.73	-	-
东财证 券	2021052 6000103 78	康泰生 物	2021-05 -26	1,143,1 04.00	6,400	14	3.80%	1,689.2 5	-	-
东财证 券	2021052 6000103 80	欧普康 视	2021-05 -26	635,50 5.00	6,500	14	3.80%	939.14	-	-
东财证 券	2021052 6000103 82	健帆生 物	2021-05 -26	815,57 5.00	8,500	14	3.80%	1,205.2 4	-	-
东财证 券	2021052 6000103	迪安诊 断	2021-05 -26	386,24 6.00	9,400	14	3.80%	570.79	-	-

	84									
东财证 券	2021052 6000103 86	智飞生 物	2021-05 -26	2,556,9 89.00	13,100	14	3.80%	3,778.6 6	-	-
东财证 券	2021052 6000103 88	乐普医 疗	2021-05 -26	819,00 0.00	25,000	14	3.80%	1,210.3 0	-	-
东财证 券	2021052 6000103 90	沃森生 物	2021-05 -26	2,310,0 00.00	33,600	14	3.80%	3,413.6 7	-	-
东财证 券	2021052 6000103 92	爱尔眼 科	2021-05 -26	3,064,4 00.00	37,600	14	3.80%	4,528.5 0	-	-
东财证 券	2021052 6000103 94	红日药 业	2021-05 -26	170,55 0.00	37,900	14	3.80%	252.04	-	-

注：本基金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

东财创业板A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金 合同生效日）至2020年1 2月31日
基金合同生效日（2020年03月18日）持有的 基金份额	0.00	10,000,450.05
报告期初持有的基金份额	10,000,450.0 5	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,450.0 5	10,000,450.05
报告期末持有的基金份额占基金总份额比 例	11.66%	8.89%

东财创业板C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01 日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年03月18日（基金 合同生效日）至2020年1 2月31日
基金合同生效日（2020年03月18日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年03月18日（基金合同生效日） 至2020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
兴业银行股份有限公司	6,019,026.92	25,430.56	6,272,571.58	57,506.14

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的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（2021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	可流通日	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
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	10.52	10.52	6,681	70,284.12	70,284.12	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	创业板新股限售	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	创业板新股限售	60.64	234.74	127	7,701.28	29,811.98	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	创业板新股限售	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	创业板新股限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	创业板新股限售	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-

				售						
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	创业板新股限售	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	创业板新股限售	60.66	96.75	188	11,404.08	18,189.00	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	创业板新股限售	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	创业板新股限售	22.04	56.28	311	6,854.44	17,503.08	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	创业板新股限售	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	创业板新股限售	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	创业板新股限售	6.96	12.51	1,105	7,690.80	13,823.55	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	创业板新股限售	116.88	116.08	119	13,908.72	13,813.52	-
3010	漱玉	2021	2022	创业	8.86	23.8	555	4,91	13,2	-

17	平民	-06-23	-01-05	板新股限售		0		7.30	09.00	
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	创业板新股限售	12.03	17.12	761	9,154.83	13,028.32	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业板新股限售	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	创业板新股限售	25.80	33.65	377	9,726.60	12,686.05	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业板新股限售	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	创业板新股限售	12.37	19.23	596	7,372.52	11,461.08	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	创业板新股限售	26.91	43.36	256	6,888.96	11,100.16	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-18	创业板新股限售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	创业板新股限售	26.17	44.86	231	6,045.27	10,362.66	-

				售						
3012 21	光庭 信息	2021 -12- 15	2022 -06- 22	创业 板新 股限 售	69.8 9	88.7 2	116	8,10 7.24	10,2 91.5 2	-
3010 28	东亚 机械	2021 -07- 12	2022 -01- 20	创业 板新 股限 售	5.31	13.5 0	733	3,89 2.23	9,89 5.50	-
3010 87	可孚 医疗	2021 -10- 15	2022 -04- 25	创业 板新 股限 售	93.0 9	75.3 4	131	12,1 94.7 9	9,86 9.54	-
3011 68	通灵 股份	2021 -12- 02	2022 -06- 10	创业 板新 股限 售	39.0 8	52.1 3	181	7,07 3.48	9,43 5.53	-
3007 74	倍杰 特	2021 -07- 26	2022 -02- 07	创业 板新 股限 售	4.57	21.0 8	444	2,02 9.08	9,35 9.52	-
3010 40	中环 海陆	2021 -07- 26	2022 -02- 07	创业 板新 股限 售	13.5 7	38.5 1	241	3,27 0.37	9,28 0.91	-
3010 90	华润 材料	2021 -10- 19	2022 -04- 26	创业 板新 股限 售	10.4 5	11.2 2	825	8,62 1.25	9,25 6.50	-
3010 78	孩子 王	2021 -09- 30	2022 -04- 14	创业 板新 股限 售	5.77	12.1 4	756	4,36 2.12	9,17 7.84	-
3010	读客	2021	2022	创业	1.55	20.8	403	624.	8,41	-

25	文化	-07-06	-01-19	板新股限售		8		65	4.64	
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	创业板新股限售	36.50	31.31	258	9,417.00	8,077.98	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	创业板新股限售	27.12	30.58	257	6,969.84	7,859.06	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	创业板新股限售	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	创业板新股限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	创业板新股限售	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	创业板新股限售	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	创业板新股限售	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	创业板新股限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

				售						
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	创业板新股限售	27.81	31.14	244	6,785.64	7,598.16	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	创业板新股限售	66.18	56.62	131	8,669.58	7,417.22	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	创业板新股限售	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板新股限售	58.08	49.85	135	7,840.80	6,729.75	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	创业板新股限售	29.28	32.00	208	6,090.24	6,656.00	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	创业板新股限售	27.85	27.46	237	6,600.45	6,508.02	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	创业板新股限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板新股限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
3010	新柴	2021	2022	创业	4.97	12.5	513	2,54	6,41	-

32	股份	-07-15	-01-24	板新股限售		1		9.61	7.63	
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	创业板新股限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	创业板新股限售	30.73	29.14	215	6,606.95	6,265.10	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-07	创业板新股限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	创业板新股限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	创业板新股限售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	创业板新股限售	43.99	50.77	119	5,234.81	6,041.63	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	创业板新股限售	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	创业板新股限售	33.16	24.67	239	7,925.24	5,896.13	-

				售						
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板新股限售	36.31	35.52	162	5,882.22	5,754.24	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	创业板新股限售	79.60	78.53	72	5,731.20	5,654.16	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	创业板新股限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	创业板新股限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业板新股限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	创业板新股限售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	创业板新股限售	57.27	53.71	90	5,154.30	4,833.90	-
301027	华蓝集团	2021-07-	2022-01-	创业板新	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-

		08	17	股限售						
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	创业板新股限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	创业板新股限售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	创业板新股限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	创业板新股限售	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

#### 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

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期	期末估值	数量（单）	期末估值
----	------	------	------	------	-------	------

			日	单价	位：股)	总额
1	300001	特锐德	2022年01月13日-2022年01月13日	24.87	8,600	213,882.00
2	300009	安科生物	2022年01月13日-2022年01月13日	13.09	22,500	294,525.00
3	300015	爱尔眼科	2022年01月13日-2022年01月13日	42.28	32,000	1,352,960.00
4	300017	网宿科技	2022年01月13日-2022年01月13日	6.69	43,300	289,677.00
5	300024	机器人	2022年01月13日-2022年01月13日	11.17	24,800	277,016.00
6	300037	新宙邦	2022年01月13日-2022年01月13日	113.00	1,900	214,700.00
7	300058	蓝色光标	2022年01月13日-2022年01月13日	10.73	46,800	502,164.00
8	300073	当升科技	2022年01月13日-2022年01月13日	86.87	2,400	208,488.00
9	300088	长信科技	2022年01	13.28	43,400	576,352.0

			月13日-2 022年01 月13日			0
10	300144	宋城演艺	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	14.32	31,100	445,352.0 0
11	300212	易华录	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	35.35	8,400	296,940.0 0
12	300223	北京君正	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	134.00	4,000	536,000.0 0
13	300244	迪安诊断	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	33.57	9,800	328,986.0 0
14	300251	光线传媒	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	12.85	23,400	300,690.0 0
15	300285	国瓷材料	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	42.57	16,100	685,377.0 0
16	300369	绿盟科技	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	15.86	12,000	190,320.0 0
17	300383	光环新网	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	14.84	23,500	348,740.0 0

			月13日			
18	300418	昆仑万维	2022年01月13日-2022年01月13日	23.15	16,100	372,715.00
19	300433	蓝思科技	2022年01月13日-2022年01月13日	22.98	41,200	946,776.00
20	300454	深信服	2022年01月13日-2022年01月13日	191.00	4,800	916,800.00
21	300476	胜宏科技	2022年01月13日-2022年01月13日	30.25	10,400	314,600.00
22	300496	中科创达	2022年01月13日-2022年01月13日	138.42	1,900	262,998.00
23	300502	新易盛	2022年01月13日-2022年01月13日	39.18	6,600	258,588.00
24	300558	贝达药业	2022年01月13日-2022年01月13日	79.83	5,200	415,116.00
25	300567	精测电子	2022年01月13日-2022年01月13日	72.43	3,900	282,477.00
26	300630	普利制药	2022年01	55.04	5,000	275,200.0

			月13日-2 022年01 月13日			0
27	300676	华大基因	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	87.80	4,900	430,220.0 0
28	300677	英科医疗	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	57.84	7,700	445,368.0 0
29	300699	光威复材	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	84.48	5,900	498,432.0 0
30	300725	药石科技	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	142.17	3,200	454,944.0 0
31	300726	宏达电子	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	100.06	2,500	250,150.0 0
32	300747	锐科激光	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	59.11	4,800	283,728.0 0
33	300748	金力永磁	2022年01 月13日-2 022年01 月13日	44.89	7,900	354,631.0 0
34	300768	迪普科技	2022年01 月13日-2 022年01	41.25	1,900	78,375.00

			月13日			
35	300773	拉卡拉	2022年01月13日-2022年01月13日	29.02	8,400	243,768.00
36	300866	安克创新	2022年01月13日-2022年01月13日	102.50	2,800	287,000.00
37	300869	康泰医学	2022年01月13日-2022年01月13日	40.55	2,600	105,430.00
38	300888	稳健医疗	2022年01月13日-2022年01月13日	82.45	2,200	181,390.00
39	300919	中伟股份	2022年01月13日-2022年01月13日	151.51	1,100	166,661.00
合计					505,000	14,887,536.00

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
----------------------------	------	------	------	-----	----

资产					
银行存款	12,754,157.80	-	-	-	12,754,157.80
交易性金融资产	-	-	-	215,275,324.79	215,275,324.79
应收利息	-	-	-	3,199.05	3,199.05
应收申购款	-	-	-	52,592.60	52,592.60
资产总计	12,754,157.80	-	-	215,331,116.44	228,085,274.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	401,005.39	401,005.39
应付管理人报酬	-	-	-	96,909.49	96,909.49
应付托管费	-	-	-	9,690.94	9,690.94
应付销售服务费	-	-	-	14,205.87	14,205.87
应交税费	-	-	-	1,272.27	1,272.27
其他负债	-	-	-	179,787.76	179,787.76
负债总计	-	-	-	702,871.72	702,871.72
利率敏感度缺口	12,754,157.80	-	-	214,628,244.72	227,382,402.52
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,251,296.51	-	-	-	18,251,296.51
交易性金融资产	-	-	-	253,190,103.49	253,190,103.49
应收利息	-	-	-	2,683.33	2,683.33

应收申购款	-	-	-	920,633.84	920,633.84
资产总计	18,251,296.51	-	-	254,113,420.66	272,364,717.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,489,716.14	6,489,716.14
应付管理人报酬	-	-	-	116,364.98	116,364.98
应付托管费	-	-	-	11,636.48	11,636.48
应付销售服务费	-	-	-	19,458.76	19,458.76
其他负债	-	-	-	143,786.07	143,786.07
负债总计	-	-	-	6,780,962.43	6,780,962.43
利率敏感度缺口	18,251,296.51	-	-	247,332,458.23	265,583,754.74

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 2021年12月31日		上年度末 2020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	215,275,324.79	94.68	253,190,103.49	95.33
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	215,275,324.79	94.68	253,190,103.49	95.33

#### 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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	11,342,664.93	13,243,510.45

	业绩比较基准下降5%	-11,342,664.93	-13,243,510.45
--	------------	----------------	----------------

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相若。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币214,506,285.21元，属于第二层次的余额为人民币75,788.61元，属于第三层次的余额为人民币693,250.97元（于2020年12月31日：属于第一层次的余额为人民币251,926,980.45元，属于第二层次的余额为人民币632,729.30元，属于第三层次的余额为人民币630,393.74元）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，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，本基金分别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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

截至本报告期末，本基金持有的以公允价值计量的金融工具属于第三层次的余额为人民币693,250.97元，系因战略配售锁定期而流通受限的股票，其估值根据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》确定的模型计算得出。

(2) 除公允价值外，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	215,275,324.79	94.38
	其中：股票	215,275,324.79	94.38
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,754,157.80	5.59
8	其他各项资产	55,791.65	0.02
9	合计	228,085,274.24	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为14,887,536.00元，占基金资产净值比例为6.55%。

## 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	5,078,091.60	2.23
B	采矿业	-	-
C	制造业	158,749,720.42	69.82
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	214,335.00	0.09
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	11,829,542.28	5.20
J	金融业	17,807,754.19	7.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,303,695.00	0.57

M	科学研究和技术服务业	8,767,136.00	3.86
N	水利、环境和公共设施管理业	762,140.00	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,195,508.52	2.72
R	文化、体育和娱乐业	3,790,406.20	1.67
S	综合	-	-
	合计	214,498,329.21	94.33

### 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	522,100.43	0.23
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	53,557.57	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,333.15	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	119,439.98	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	34,380.03	0.02
O	居民服务、修理和其他服	-	-

	务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	776,995.58	0.34

### 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	300750	宁德时代	63,600	37,396,800.00	16.45
2	300059	东方财富	436,229	16,188,458.19	7.12
3	300760	迈瑞医疗	23,216	8,840,652.80	3.89
4	300014	亿纬锂能	68,403	8,083,866.54	3.56
5	300274	阳光电源	53,200	7,756,560.00	3.41
6	300124	汇川技术	95,200	6,530,720.00	2.87
7	300015	爱尔眼科	126,209	5,336,116.52	2.35
8	300498	温氏股份	263,660	5,078,091.60	2.23
9	300122	智飞生物	40,100	4,996,460.00	2.20
10	300142	沃森生物	87,700	4,928,740.00	2.17
11	300450	先导智能	54,600	4,060,602.00	1.79
12	300347	泰格医药	28,900	3,693,420.00	1.62
13	300782	卓胜微	11,276	3,684,996.80	1.62
14	300408	三环集团	62,600	2,791,960.00	1.23
15	300207	欣旺达	58,700	2,474,792.00	1.09

16	300433	蓝思科技	107,000	2,458,860.00	1.08
17	300896	爱美客	4,500	2,412,495.00	1.06
18	300454	深信服	12,630	2,412,330.00	1.06
19	300661	圣邦股份	7,800	2,410,200.00	1.06
20	300496	中科创达	16,900	2,339,298.00	1.03
21	300316	晶盛机电	32,400	2,251,800.00	0.99
22	300012	华测检测	77,600	2,085,112.00	0.92
23	300999	金龙鱼	31,100	1,957,123.00	0.86
24	300601	康泰生物	19,600	1,931,384.00	0.85
25	300759	康龙化成	13,200	1,864,764.00	0.82
26	300413	芒果超媒	32,400	1,853,928.00	0.82
27	300285	国瓷材料	41,800	1,779,426.00	0.78
28	300390	天华超净	21,200	1,717,200.00	0.76
29	300073	当升科技	19,300	1,676,591.00	0.74
30	300037	新宙邦	14,400	1,627,200.00	0.72
31	300033	同花顺	11,200	1,619,296.00	0.71
32	300253	卫宁健康	96,410	1,615,831.60	0.71
33	300751	迈为股份	2,500	1,605,750.00	0.71
34	300769	德方纳米	3,100	1,522,596.00	0.67
35	300088	长信科技	112,600	1,495,328.00	0.66
36	300003	乐普医疗	63,200	1,430,216.00	0.63
37	300223	北京君正	10,500	1,407,000.00	0.62
38	300595	欧普康视	24,400	1,399,828.00	0.62
39	300628	亿联网络	17,050	1,388,722.50	0.61
40	300724	捷佳伟创	11,900	1,360,170.00	0.60
41	300568	星源材质	35,600	1,307,588.00	0.58
42	300058	蓝色光标	121,500	1,303,695.00	0.57
43	300699	光威复材	15,400	1,300,992.00	0.57
44	300146	汤臣倍健	47,800	1,288,688.00	0.57
45	300529	健帆生物	23,556	1,255,534.80	0.55
46	300725	药石科技	8,300	1,180,011.00	0.52

47	300677	英科医疗	20,000	1,156,800.00	0.51
48	300144	宋城演艺	80,760	1,156,483.20	0.51
49	300763	锦浪科技	4,910	1,136,910.50	0.50
50	300308	中际旭创	26,700	1,134,750.00	0.50
51	300136	信维通信	44,449	1,125,448.68	0.49
52	300676	华大基因	12,800	1,123,840.00	0.49
53	300558	贝达药业	13,500	1,077,705.00	0.47
54	300296	利亚德	103,800	1,063,950.00	0.47
55	300474	景嘉微	6,400	974,080.00	0.43
56	300418	昆仑万维	41,800	967,670.00	0.43
57	300618	寒锐钴业	12,000	962,160.00	0.42
58	300373	扬杰科技	14,000	940,520.00	0.41
59	300748	金力永磁	20,520	921,142.80	0.41
60	300502	新易盛	23,144	906,781.92	0.40
61	300383	光环新网	61,000	905,240.00	0.40
62	300244	迪安诊断	25,600	859,392.00	0.38
63	300115	长盈精密	43,100	855,104.00	0.38
64	300001	特锐德	34,300	853,041.00	0.38
65	300357	我武生物	14,500	830,850.00	0.37
66	300476	胜宏科技	27,200	822,800.00	0.36
67	300630	普利制药	14,549	800,776.96	0.35
68	300251	光线传媒	60,700	779,995.00	0.34
69	300212	易华录	21,940	775,579.00	0.34
70	300866	安克创新	7,500	768,750.00	0.34
71	300009	安科生物	58,528	766,131.52	0.34
72	300070	碧水源	106,000	762,140.00	0.34
73	300017	网宿科技	112,300	751,287.00	0.33
74	300567	精测电子	10,300	746,029.00	0.33
75	300775	三角防务	15,100	738,239.00	0.32
76	300747	锐科激光	12,400	732,964.00	0.32
77	300682	朗新科技	19,600	725,788.00	0.32

78	300024	机器人	64,300	718,231.00	0.32
79	300171	东富龙	13,500	682,290.00	0.30
80	300957	贝泰妮	3,500	672,980.00	0.30
81	300832	新产业	15,200	669,560.00	0.29
82	300726	宏达电子	6,600	660,396.00	0.29
83	300773	拉卡拉	21,984	637,975.68	0.28
84	300457	赢合科技	19,600	602,112.00	0.26
85	300463	迈克生物	20,600	601,314.00	0.26
86	300294	博雅生物	15,500	594,425.00	0.26
87	300482	万孚生物	13,520	532,417.60	0.23
88	300298	三诺生物	17,000	508,470.00	0.22
89	300369	绿盟科技	31,300	496,418.00	0.22
90	300456	赛微电子	19,700	483,832.00	0.21
91	300888	稳健医疗	5,800	478,210.00	0.21
92	300919	中伟股份	2,900	439,379.00	0.19
93	300979	华利集团	4,800	427,440.00	0.19
94	300841	康华生物	1,900	404,168.00	0.18
95	300861	美畅股份	4,600	357,742.00	0.16
96	300741	华宝股份	6,700	320,595.00	0.14
97	300973	立高食品	2,200	290,576.00	0.13
98	300869	康泰医学	6,900	279,795.00	0.12
99	300783	三只松鼠	5,500	214,335.00	0.09
100	300768	迪普科技	4,900	202,125.00	0.09

### 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	301136	招标股份	6,681	70,284.12	0.03
2	301029	怡合达	462	41,519.94	0.02

3	301050	雷电微力	127	29,811.98	0.01
4	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
5	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
6	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.01
7	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
8	301155	海力风电	188	18,189.00	0.01
9	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
10	301035	润丰股份	311	17,503.08	0.01
11	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
12	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
13	301039	中集车辆	1,105	13,823.55	0.01
14	301177	迪阿股份	119	13,813.52	0.01
15	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
16	301127	天源环保	761	13,028.32	0.01
17	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
18	301211	亨迪药业	377	12,686.05	0.01
19	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
20	301126	达嘉维康	596	11,461.08	0.01
21	301101	明月镜片	256	11,100.16	0.00
22	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
23	301138	华研精机	231	10,362.66	0.00
24	301221	光庭信息	116	10,291.52	0.00
25	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
26	301087	可孚医疗	131	9,869.54	0.00
27	301168	通灵股份	181	9,435.53	0.00
28	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
29	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
30	301090	华润材料	825	9,256.50	0.00
31	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
32	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
33	301091	深城交	258	8,077.98	0.00

34	300952	恒辉安防	340	7,956.00	0.00
35	301182	凯旺科技	257	7,859.06	0.00
36	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
37	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
38	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
39	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
40	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
41	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
42	301100	风光股份	244	7,598.16	0.00
43	301189	奥尼电子	131	7,417.22	0.00
44	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
45	301093	华兰股份	135	6,729.75	0.00
46	301199	迈赫股份	208	6,656.00	0.00
47	301190	善水科技	237	6,508.02	0.00
48	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
49	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
50	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
51	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
52	301193	家联科技	215	6,265.10	0.00
53	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
54	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
55	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
56	301179	泽宇智能	119	6,041.63	0.00
57	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
58	301088	戎美股份	239	5,896.13	0.00
59	301092	争光股份	162	5,754.24	0.00
60	301096	百诚医药	72	5,654.16	0.00
61	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
62	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
63	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
64	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00

65	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
66	301108	洁雅股份	90	4,833.90	0.00
67	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
68	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
69	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
70	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
71	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	300750	宁德时代	14,095,469.00	5.31
2	300059	东方财富	6,658,355.24	2.51
3	300760	迈瑞医疗	4,705,115.00	1.77
4	300122	智飞生物	3,827,106.00	1.44
5	300896	爱美客	3,483,761.80	1.31
6	300015	爱尔眼科	3,469,807.00	1.31
7	300014	亿纬锂能	3,251,600.00	1.22
8	300124	汇川技术	3,070,371.50	1.16
9	300274	阳光电源	2,897,181.00	1.09
10	300142	沃森生物	2,539,922.50	0.96
11	300782	卓胜微	2,282,801.08	0.86
12	300347	泰格医药	2,221,062.00	0.84
13	300498	温氏股份	2,116,458.00	0.80
14	300390	天华超净	2,097,474.00	0.79
15	300769	德方纳米	2,021,017.00	0.76
16	300725	药石科技	1,749,501.00	0.66
17	300454	深信服	1,732,758.00	0.65
18	300433	蓝思科技	1,668,541.00	0.63

19	300450	先导智能	1,628,183.00	0.61
20	300568	星源材质	1,595,695.00	0.60

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	300750	宁德时代	24,463,482.94	9.21
2	300059	东方财富	13,758,218.00	5.18
3	300760	迈瑞医疗	9,362,301.00	3.53
4	300015	爱尔眼科	6,897,417.31	2.60
5	300124	汇川技术	5,869,192.30	2.21
6	300274	阳光电源	5,623,095.49	2.12
7	300014	亿纬锂能	5,552,162.00	2.09
8	300122	智飞生物	5,336,402.00	2.01
9	300142	沃森生物	4,818,455.00	1.81
10	300347	泰格医药	4,471,763.52	1.68
11	300498	温氏股份	4,384,921.00	1.65
12	300782	卓胜微	3,456,282.20	1.30
13	300450	先导智能	3,158,213.00	1.19
14	300454	深信服	2,549,268.00	0.96
15	300413	芒果超媒	2,508,627.00	0.94
16	300408	三环集团	2,286,645.50	0.86
17	300012	华测检测	2,138,552.11	0.81
18	300601	康泰生物	2,135,612.00	0.80
19	300433	蓝思科技	1,992,068.00	0.75
20	300496	中科创达	1,986,480.00	0.75

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	125,925,218.15
卖出股票收入（成交）总额	203,142,989.63

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

沃森生物：2021年7月1日，中国证券监督管理委员会云南监管局对云南沃森生物技术股份有限公司采取责令改正的措施。

本基金为指数型基金，采取完全复制策略，跟踪的标的指数为创业板指数，沃森生物为指数成份股。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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,199.05
5	应收申购款	52,592.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,791.65

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300015	爱尔眼科	1,352,960.00	0.60	转融通证券出借

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301136	招标股份	70,284.12	0.03	新股未上市
2	301029	怡合达	41,519.94	0.02	创业板新股限

					售
3	301050	雷电微力	29,811.98	0.01	创业板新股限售
4	301058	中粮工科	25,280.64	0.01	创业板新股限售
5	301069	凯盛新材	23,829.19	0.01	创业板新股限售

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
东财创业板A	6,825	12,562.68	10,000,645.81	11.66%	75,739,612.65	88.34%
东财创业板C	3,284	11,368.23	0.00	0.00%	37,333,277.32	100.00%
合计	9,744	12,630.70	10,000,645.81	8.13%	113,072,889.97	91.87%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持	东财创业板A	205.02	0.00%

有本基金	东财创业板C	259.82	0.00%
	合计	464.84	0.00%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.05	8.13%	10,000,450.05	8.13%	3年
基金管理人高级管理人员	99.88	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,549.93	8.13%	10,000,450.05	8.13%	3年

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	东财创业板A	东财创业板C
--	--------	--------

基金合同生效日(2020年03月18日)基金份额总额	165,975,337.32	87,195,793.81
本报告期期初基金份额总额	112,543,480.95	54,127,242.21
本报告期基金总申购份额	89,889,513.37	82,047,438.52
减:本报告期基金总赎回份额	116,692,735.86	98,841,403.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	85,740,258.46	37,333,277.32

注: 申购份额含红利再投、转换入份额; 赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人: 自2021年3月23日起, 沙福贵先生担任公司副总经理职务; 自2021年4月30日起, 荀航先生担任公司副总经理职务; 自2021年8月6日起, 沙福贵先生担任公司总经理职务, 潘世友先生不再担任总经理职务。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内, 本基金投资策略未发生重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 本基金基金管理人及其高级管理人员、基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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	
广发证券	2	323,591,290.74	100.00%	102,388.01	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金2020年第4季度报告	证监会规定网站	2021-01-21
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	证监会规定报刊及网站	2021-01-29
3	西藏东财基金管理有限公司关于提示投资者持续完善客户身份信息的公告	证监会规定报刊及网站	2021-01-30
4	西藏东财基金管理有限公司关于旗下指数基金指数信息查询途径的公告	证监会规定报刊及网站	2021-01-30
5	西藏东财基金管理有限公司关于公司住所变更公告	证监会规定报刊及网站	2021-03-03

6	西藏东财基金管理有限公司 高级管理人员任职公告	证监会规定报刊及网站	2021-03-23
7	西藏东财创业板指数型发起 式证券投资基金2020年年度 报告	证监会规定网站	2021-03-30
8	西藏东财基金管理有限公司 关于旗下部分基金根据《公 开募集证券投资基金运作指 引第3号——指数基金指引》 修改基金合同部分条款的公 告	证监会规定报刊及网站	2021-03-31
9	西藏东财创业板指数型发起 式证券投资基金基金产品资 料概要更新（2021年3月31 日）	证监会规定网站	2021-03-31
10	西藏东财创业板指数型发起 式证券投资基金基金合同更 新（2021年3月）	证监会规定网站	2021-03-31
11	西藏东财创业板指数型发起 式证券投资基金托管协议更 新（2021年3月）	证监会规定网站	2021-03-31
12	西藏东财创业板指数型发起 式证券投资基金招募说明书 更新（2021年第1号）	证监会规定网站	2021-03-31
13	西藏东财创业板指数型发起 式证券投资基金2021年第1 季度报告	证监会规定网站	2021-04-21
14	西藏东财基金管理有限公司 高级管理人员任职公告	证监会规定报刊及网站	2021-05-01
15	西藏东财基金管理有限公司 关于旗下基金参与招商证券 股份有限公司认购、申购(含 定期定额投资)费率优惠活	证监会规定报刊及网站	2021-06-19

	动的公告		
16	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与珠海盈米基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	证监会规定报刊及网站	2021-07-01
17	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	证监会规定报刊及网站	2021-07-07
18	西藏东财基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	证监会规定报刊及网站	2021-07-13
19	西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金2021年第2季度报告	证监会规定网站	2021-07-20
20	西藏东财基金管理有限公司关于提示投资者持续完善客户身份信息公告	证监会规定报刊及网站	2021-07-21
21	西藏东财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会规定报刊及网站	2021-08-07
22	西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金2021年中期报告	证监会规定网站	2021-08-27
23	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与天风证券股份有限公司认购、申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	证监会规定报刊及网站	2021-09-01
24	西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金2021年第3季度报告	证监会规定网站	2021-10-26
25	西藏东财基金管理有限公司	证监会规定报刊及网站	2021-11-04

	关于旗下基金参与青岛意才基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告		
26	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与宜信普泽（北京）基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	证监会规定报刊及网站	2021-11-24
27	西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金更新招募说明书（2021年第2号）	证监会规定网站	2021-12-23
28	西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新（2021年12月23日）	证监会规定网站	2021-12-23

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

西藏东财基金管理有限公司

二〇二二年三月二十九日