
西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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:招商证券股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2022年8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2022年1月1日起至2022年6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	7
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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	58
7.1 期末基金资产组合情况	58
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	60
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69

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	69
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§12 备查文件目录	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	东财有色增强	
基金主代码	011630	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年03月16日	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	281,938,474.56份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财有色增强A	东财有色增强C
下属分级基金的交易代码	011630	011631
报告期末下属分级基金的份额总额	127,515,654.79份	154,422,819.77份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	1、指数化投资策略 本基金将运用指数化的投资方法，通过参考标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数中权重的偏离，以控制跟踪误差，进而达成对标的指数的跟踪目标。 2、指数增强策略 指数增强策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，运用数量化的策略体系构建投资组合，实现在偏离度控制的基础上获取超额收益，主要包括多因子选股策略、事件驱动策略和风险优化策略。
业绩比较基准	中证有色金属指数收益率×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、债券型基金和混合型基金。同时，本基金属于指数增强型基金，跟踪标的指数，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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	沙福贵
	联系电话	021-23526999
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com
客户服务电话	400-9210-107	95565
传真	021-23526940	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码	200030	518000
法定代表人	戴彦	霍达

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 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	东财有色增强A	东财有色增强C
本期已实现收益	-11,449,752.41	-15,083,101.76
本期利润	-1,047,863.55	-3,340,338.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0085	-0.0213
本期加权平均净值利润率	-0.62%	-1.55%
本期基金份额净值增长率	-0.39%	-0.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
	东财有色增强A	东财有色增强C
期末可供分配利润	20,036,785.81	23,461,876.89
期末可供分配基金份额利润	0.1571	0.1519
期末基金资产净值	187,305,860.49	225,955,536.14
期末基金份额净值	1.4689	1.4632
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
	东财有色增强A	东财有色增强C
基金份额累计净值增长率	46.89%	46.32%

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

东财有色增强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
过去一个月	11.04%	2.07%	9.96%	2.00%	1.08%	0.07%
过去三个月	6.51%	2.47%	4.67%	2.47%	1.84%	0.00%
过去六个月	-0.39%	2.21%	-2.79%	2.19%	2.40%	0.02%
过去一年	28.27%	2.25%	19.32%	2.26%	8.95%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	46.89%	2.14%	22.02%	2.18%	24.87%	-0.04%

东财有色增强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
过去一个月	11.01%	2.07%	9.96%	2.00%	1.05%	0.07%
过去三个月	6.43%	2.47%	4.67%	2.47%	1.76%	0.00%
过去六个月	-0.54%	2.21%	-2.79%	2.19%	2.25%	0.02%
过去一年	27.88%	2.25%	19.32%	2.26%	8.56%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	46.32%	2.14%	22.02%	2.18%	24.30%	-0.04%

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

东财有色增强A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03月16日-2022年06月30日)



东财有色增强C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03月16日-2022年06月30日)



- 注：1、本基金基金合同于2021年3月16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2022年6月30日，公司旗下管理26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、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）、西藏东财品质生活优选混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职 日期	离任 日期		

姚楠燕	本基金基金经理、西藏东财创业板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、西藏东财沪深300指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财上证50	2021-03-16	—	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限公司担任金融学/会计学研究助理、筹备组成员、投资助理、基金经理助理兼研究员等职务。
-----	---	------------	---	-----	---

	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				
杨路炜	本基金基金经理、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、西藏东财中证云计算与大数据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、西藏东财中证食品饮料指数增强型发起式证券	2021-03-16	-	6 年	北京大学软件工程硕士（金融工程方向）。自2016年始，先后在兴业经济研究咨询股份有限公司、西藏东财基金管理有限公司担任分析师、量化研究员等职务。

	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、量化研究员				
--	---	--	--	--	--

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

4.1.3 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 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 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

本基金为指数增强型基金，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，在控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的同时，力争基金的净值增长超越业绩基准。

报告期内基金较好的完成了跟踪目标，通过使用定量分析等技术，分析和应对导致基金跟踪误差的因素，控制投资组合和基准之间的风格偏离，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平。在增强方面，主要应用多因子选股、事件驱动、风险优化等策略，并根据市场风格变化不定期对组合进行优化，力争获取稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年06月30日，东财有色增强A份额净值为1.4689元，报告期内基金份额净值增长率为-0.39%，东财有色增强C份额净值为1.4632元，报告期内基金份额净值增长率为-0.54%，同期业绩比较基准收益率为-2.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年上半年，国际环境更趋复杂严峻，国内疫情多发散发，经济下行压力进一步凸显。俄乌冲突趋于长期化，地区热点和地缘政治冲突有加剧趋势。受国际政治格局博弈和疫情对产业链供应链的影响，海外通胀持续高企，能源和粮食供应缺口持续引发多国社会动荡。为抑制通胀、稳定通胀预期和加快实际通胀水平向政策目标水平回落速度，以美联储为代表的欧美发达国家央行继续加快收紧货币政策节奏，7月联储议息会议决定再次加息75bp，年内预计仍将维持收紧态势。

国内经济在经受住多个主要城市新冠疫情蔓延冲击后，经济总体呈现稳定恢复态势。上半年，按不变价计算，GDP同比增速达到2.5%，取得了来之不易的成绩。在统筹疫情防控和经济社会发展的背景下，财政政策继续靠前发力，专项债发行提速，重大基础设施项目陆续开工。货币政策继续保持稳健中性，同时加大银行信贷对实体经济的支持力度。各项政策正逐步落地，政策效力正逐步发挥。

展望年内，随着美国中期选举等政治性事件在三四季度将趋于频繁，海外货币政策收紧面临更多权衡挑战，同时国内各项稳增长政策力求落实，经济高质量发展和转型升级步伐仍在加速，股票市场仍将具有投资机会，部分行业的结构性机会仍将凸显。

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、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

本基金本报告期未发生相关预警情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司（以下称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人复核审查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。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	35,844,296.98	24,828,001.17
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	382,968,905.68	398,035,952.26
其中：股票投资		382,968,905.68	398,035,952.26
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,643,261.10	33,324.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	9,662.41
资产总计		422,456,463.76	422,906,940.24
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2022年06月30日	2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		8,640,503.53	2,806,499.30
应付管理人报酬		391,778.68	440,633.21
应付托管费		32,648.21	36,719.42
应付销售服务费		53,554.88	62,631.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	76,581.83	114,761.00
负债合计		9,195,067.13	3,461,244.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	281,938,474.56	284,809,705.96
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	131,322,922.07	134,635,990.15
净资产合计		413,261,396.63	419,445,696.11
负债和净资产总计		422,456,463.76	422,906,940.24

注：报告截止日2022年6月30日，东财有色增强A基金份额净值1.4689元，基金份额总额127,515,654.79份；东财有色增强C基金份额净值1.4632元，基金份额总额154,422,819.77份。基金份额总额合计为281,938,474.56份。

6.2 利润表

会计主体：西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2022年01月01日至 2022年06月30日	2021年03月16日（基金 合同生效日）至2021 年06月30日
一、营业总收入		-1,519,654.27	20,341,596.22
1. 利息收入		148,818.46	63,990.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	134,593.47	63,990.42
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		14,224.99	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-24,702,041.94	9,128,667.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-27,166,725.80	8,477,940.87
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	2,464,683.86	650,726.41
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	22,144,652.35	10,724,706.33
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.17	888,916.86	424,232.19

号填列)			
减：二、营业总支出		2,868,547.55	1,004,937.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,286,112.74	552,030.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	190,509.42	46,002.62
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	320,466.04	48,433.79
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		51.23	-
8. 其他费用	6.4.7.19	71,408.12	358,470.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,388,201.82	19,336,658.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,388,201.82	19,336,658.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,388,201.82	19,336,658.26

注：本基金基金合同生效日为2021年3月16日，上年度实际可比期间为2021年3月16日至2021年6月30日。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	284,809,705. 96	-	134,635,990. 15	419,445,696. 11
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	284,809,705. 96	-	134,635,990. 15	419,445,696. 11
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-2,871,231.4 0	-	-3,313,068.0 8	-6,184,299.4 8
(一)、综合收益总额	-	-	-4,388,201.8 2	-4,388,201.8 2
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,871,231.4 0	-	1,075,133.74	-1,796,097.6 6
其中: 1. 基金申购款	212,899,140. 12	-	84,160,627.8 5	297,059,767. 97
2. 基金赎回款	-215,770,37 1.52	-	-83,085,494. 11	-298,855,86 5.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	281,938,474. 56	-	131,322,922. 07	413,261,396. 63
项 目	上年度可比期间			

	2021年03月16日（基金合同生效日）至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	142,941,519. 36	-	-	142,941,519. 36
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	142,941,519. 36	-	-	142,941,519. 36
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	2,680,580.51	-	21,089,336.3 2	23,769,916.8 3
（一）、综合收益总额	-	-	19,336,658.2 6	19,336,658.2 6
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,680,580.51	-	1,752,678.06	4,433,258.57
其中：1. 基金申购款	106,726,497. 03	-	13,037,076.8 0	119,763,573. 83
2. 基金赎回款	-104,045,91 6.52	-	-11,284,398. 74	-115,330,31 5.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 （基金净值）	145,622,099. 87	-	21,089,336.3 2	166,711,436. 19

注：本基金基金合同生效日为2021年3月16日，上年度实际可比期间为2021年3月16日至2021年6月30日。

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

西藏东财中证有色金属指数增强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《西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财中证有色金属指数增强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[2021]482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142,941,519.36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00120号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2021年3月16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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《西藏东财中证有色金属指数增强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具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、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、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金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的股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于标的指数成份股和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、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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：中证有色金属指数收益率 $\times$ 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、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板》第3号《年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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不一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本基金财务报表的实际编制期间为2022年1月1日至2022年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金

融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

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。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币0元。

6.4.4.10 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1.20%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0.10%的年费率逐日计提。

东财有色增强A基金份额不收取销售服务费；东财有色增强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0.30%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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类/级别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 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。

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

根据财政部发布的《企业会计准则第22号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号-金融资产转移》、《企业会计准则第24号-套期会计》和《企业会计准则第37号-金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021年的比较数据将不作重述。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金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，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	11,708,330.18
等于：本金	11,703,085.80
加：应计利息	5,244.38
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	24,135,966.80
等于：本金	24,132,293.29
加：应计利息	3,673.51

减：坏账准备	-
合计	35,844,296.98

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		366,953,708.18	-	382,968,905.68	16,015,197.50
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		366,953,708.18	-	382,968,905.68	16,015,197.50

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

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,114.05
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	11,900.75
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	59.66
合计	76,581.83

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 东财有色增强A**

金额单位：人民币元

项目 (东财有色增强A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,011,514.08	123,011,514.08
本期申购	72,096,878.70	72,096,878.70
本期赎回（以“-”号填列）	-67,592,737.99	-67,592,737.99
本期末	127,515,654.79	127,515,654.79

6.4.7.7.2 东财有色增强C

金额单位：人民币元

项目 (东财有色增强C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	161,798,191.88	161,798,191.88
本期申购	140,802,261.42	140,802,261.42
本期赎回（以“-”号填列）	-148,177,633.53	-148,177,633.53
本期末	154,422,819.77	154,422,819.77

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 东财有色增强A

单位：人民币元

项目 (东财有色增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	30,973,050.64	27,421,192.43	58,394,243.07
本期利润	-11,449,752.41	10,401,888.86	-1,047,863.55
本期基金份额交易产生的变动数	513,487.58	1,930,338.60	2,443,826.18
其中：基金申购款	13,922,165.20	14,244,513.08	28,166,678.28
基金赎回款	-13,408,677.62	-12,314,174.48	-25,722,852.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,036,785.81	39,753,419.89	59,790,205.70

6.4.7.8.2 东财有色增强C

单位：人民币元

项目 (东财有色增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	40,181,116.01	36,060,631.07	76,241,747.08
本期利润	-15,083,101.76	11,742,763.49	-3,340,338.27
本期基金份额交易产生的变动数	-1,636,137.36	267,444.92	-1,368,692.44
其中：基金申购款	27,593,902.60	28,400,046.97	55,993,949.57

基金赎回款	-29,230,039.96	-28,132,602.05	-57,362,642.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,461,876.89	48,070,839.48	71,532,716.37

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	92,112.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	42,481.21
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	134,593.47

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 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	517,542,272.08
减：卖出股票成本总额	543,635,845.62
减：交易费用	1,073,152.26
买卖股票差价收入	-27,166,725.80

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投资收益。

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 2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,464,683.86
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,464,683.86

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	22,144,652.35
——股票投资	22,144,652.35
——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	22,144,652.35

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	881,997.62
转换费收入	6,919.24
合计	888,916.86

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。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内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 2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
合计	71,408.12

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

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构、基金证券经纪商
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
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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年03月16日（基金合同生效日） 至2021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
招商证券	1,007,927,766.63	100.00%	373,759,462.78	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 2022年01月01日至2022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
招商证券	427,777.28	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年03月16日（基金合同生效日）至2021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
招商证券	158,826.01	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 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年03月16日（基金合同 生效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,286,112.74	552,030.95
其中：支付销售机构的客户维护费	1,091,993.14	240,929.74

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%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：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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 2022年01月01日 至2022年06月30 日	上年度可比期间 2021年03月16日（基金合同生 效日）至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	190,509.42	46,002.62

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%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：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财有色增强A	东财有色增强C	合计
上海天天 基金销售 有限公司	0.00	301,524.67	301,524.67
东方财富 证券股份 有限公司	0.00	5,759.59	5,759.59
招商证券 股份有限 公司	0.00	2,403.95	2,403.95
合计	0.00	309,688.21	309,688.21
获得销售 服务费的	上年度可比期间 2021年03月16日（基金合同生效日）至2021年06月30日		

各关联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财有色增强A	东财有色增强C	合计
上海天天基金销售有限公司	0.00	37,718.72	37,718.72
东方财富证券股份有限公司	0.00	7,212.23	7,212.23
招商证券股份有限公司	0.00	3,422.60	3,422.60
合计	0.00	48,353.55	48,353.55

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0.30%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：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

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

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

东财有色增强A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01 日至2022年06 月30日	上年度可比期间 2021年03月16日（基金 合同生效日）至2021年0 6月30日
基金合同生效日（2021年03月16日）持有的 基金份额	0.00	10,000,458.38
报告期初持有的基金份额	10,000,458.3 8	0.00
报告期间申购/买入总份额	640,656.03	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	10,641,114.4 1	10,000,458.38
报告期末持有的基金份额占基金总份额比 例	8.34%	11.24%

东财有色增强C

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01 日至2022年06 月30日	上年度可比期间 2021年03月16日（基金 合同生效日）至2021年0 6月30日
基金合同生效日（2021年03月16日）持有的 基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%
---------------------	-------	-------

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

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

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。

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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年03月16日（基金合同生效日） 至2021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
招商证券-托管户	11,708,330.18	92,112.26	4,985,760.83	37,339.79
招商证券-证券资金户	24,135,966.80	42,481.21	9,161,136.91	26,650.63

注：1、本基金的银行存款存放在托管人招商证券在交通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招商证券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招商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

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。

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（2022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
688281	华秦科技	2022-02-28	6个月	科创板新股限售	189.50	246.22	1,515	205,039.00	373,023.30	-
688045	必易微	2022-05-19	6个月	科创板新股限售	55.15	61.98	3,939	217,235.85	244,139.22	-
688322	奥比中光	2022-06-30	5个交易日	新股未上市	30.99	30.99	7,610	235,833.90	235,833.90	-
688207	格灵深瞳	2022-03-09	6个月	科创板新股限售	39.49	26.38	7,514	296,727.86	198,219.32	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	38.46	38.46	4,973	191,261.58	191,261.58	-
688209	英集芯	2022-04-12	6个月	科创板新股限售	24.23	27.58	6,231	150,977.13	171,850.98	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个交易日	新股未上市	3.82	3.82	44,798	171,128.36	171,128.36	-
688400	凌云光	2022-06-27	7个交易日	新股未上市	21.93	21.93	7,278	159,606.54	159,606.54	-

688125	安达智能	2022-04-08	6个月	科创板新股限售	60.55	43.43	3,585	217,071.75	155,696.55	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	9个交易日	新股未上市	33.65	33.65	4,502	151,492.30	151,492.30	-
688237	超卓航科	2022-06-24	5个交易日	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688225	亚信安全	2022-01-26	6个月	科创板新股限售	30.51	21.00	4,435	135,311.85	93,135.00	-
688163	赛伦生物	2022-03-02	6个月	科创板新股限售	33.03	23.56	3,607	119,139.21	84,980.92	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	8个交易日	新股未上市	41.52	41.52	1,576	65,435.52	65,435.52	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	创业板新股限售	19.18	32.07	1,029	19,736.22	33,000.03	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月	创业板新股限售	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301266	宇邦新材	2022-05-30	6个月	创业板新股限售	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-

301263	泰恩康	2022-03-22	6个月	创业板新股限售	19.93	31.38	658	13,113.94	20,648.04	-
301187	欧圣电气	2022-04-13	6个月	创业板新股限售	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月	创业板新股限售	28.50	34.87	545	15,532.50	19,004.15	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	创业板新股限售	52.03	56.42	333	17,325.99	18,787.86	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月	创业板新股限售	17.27	14.83	1,245	21,501.15	18,463.35	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	创业板新股限售	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301201	诚达药业	2022-01-12	6个月	创业板新股限售	72.69	71.54	252	18,317.88	18,028.08	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月	创业板新股限售	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301256	华融化学	2022-03-	6个月	创业板新	8.05	10.08	1,725	13,886.2	17,388.0	-

		14		股限售				5	0	
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	创业板新股限售	33.68	43.98	383	12,899.44	16,844.34	-
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	创业板新股限售	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月	创业板新股限售	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月	创业板新股限售	72.88	31.38	498	24,196.16	15,627.24	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6个月	创业板新股限售	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6个月	创业板新股限售	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	创业板新股限售	42.50	32.02	437	14,280.00	13,992.74	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	创业板新股限售	34.81	16.14	864	20,050.56	13,944.96	-

301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	创业板新股限售	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月	创业板新股限售	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	创业板新股限售	163.56	82.76	154	16,846.68	12,745.04	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月	创业板新股限售	35.68	29.84	420	14,985.60	12,532.80	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月	创业板新股限售	76.56	51.92	240	18,374.40	12,460.80	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	创业板新股限售	39.88	31.09	399	15,912.12	12,404.91	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月	创业板新股限售	109.30	45.69	270	19,674.00	12,336.30	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6个月	创业板新股限售	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301207	华兰疫苗	2022-02-	6个月	创业板新	56.88	56.42	214	12,172.3	12,073.8	-

		10		股限售				2	8	
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	创业板新股限售	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月	创业板新股限售	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301116	益客食品	2022-01-10	6个月	创业板新股限售	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	创业板新股限售	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6个月	创业板新股限售	56.69	41.86	257	14,569.33	10,758.02	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	创业板新股限售	173.98	87.82	122	11,830.64	10,714.04	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月	创业板新股限售	48.30	41.68	254	12,268.20	10,586.72	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月	创业板新股限售	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-

301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月	创业板新股限售	30.82	21.46	450	13,869.00	9,657.00	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	创业板新股限售	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6个月	创业板新股限售	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6个月	创业板新股限售	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6个月	创业板新股限售	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	创业板新股限售	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301110	青木股份	2022-03-04	6个月	创业板新股限售	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	创业板新股限售	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
300834	星辉环材	2022-01-	6个月	创业板新	55.57	30.03	250	13,892.5	7,507.50	-

		06		股限售				0		
301279	金道科技	2022-04-06	6个月	创业板新股限售	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	创业板新股限售	64.08	37.52	149	9,547.92	5,590.48	-

6.4.12.2 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。

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

截至本报告期末2022年6月30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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2022年6月30日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为股票指数增强型基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，运用数量化的策略体系构建投资组合，实现在偏离度控制的基础上获取超额收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

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及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,844,296.98	-	-	-	35,844,296.98
交易性	-	-	-	382,968,905.68	382,968,905.68

金融资产					
应收申购款	-	-	-	3,643,261.10	3,643,261.10
资产总计	35,844,296.98	-	-	386,612,166.78	422,456,463.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,640,503.53	8,640,503.53
应付管理人报酬	-	-	-	391,778.68	391,778.68
应付托管费	-	-	-	32,648.21	32,648.21
应付销售服务费	-	-	-	53,554.88	53,554.88
其他负债	-	-	-	76,581.83	76,581.83
负债总计	-	-	-	9,195,067.13	9,195,067.13
利率敏感度缺口	35,844,296.98	-	-	377,417,099.65	413,261,396.63
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,828,001.17	-	-	-	24,828,001.17
交易性金融资产	-	-	-	398,035,952.26	398,035,952.26
应收利息	-	-	-	9,662.41	9,662.41
应收申购款	-	-	-	33,324.40	33,324.40
资产总计	24,828,001.17	-	-	398,078,939.07	422,906,940.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,806,499.30	2,806,499.30
应付管	-	-	-	440,633.21	440,633.21

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	36,719.42	36,719.42
应付销售服务费	-	-	-	62,631.20	62,631.20
其他负债	-	-	-	114,761.00	114,761.00
负债总计	-	-	-	3,461,244.13	3,461,244.13
利率敏感度缺口	24,828,001.17	-	-	394,617,694.94	419,445,696.11

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策进行分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	382,968,905.68	92.67	398,035,952.26	94.90
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	382,968,905.68	92.67	398,035,952.26	94.90

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	20,564,555.65	19,656,361.12
	业绩比较基准下降5%	-20,564,555.65	-19,656,361.12

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	379,882,782.12	395,470,191.67
第二层次	1,094,069.77	233,971.03
第三层次	1,992,053.79	2,331,789.56
合计	382,968,905.68	398,035,952.26

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年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（2021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	382,968,905.68	90.65
	其中：股票	382,968,905.68	90.65
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	35,844,296.98	8.48
8	其他各项资产	3,643,261.10	0.86
9	合计	422,456,463.76	100.00

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	—	—
B	采矿业	84,261,432.63	20.39
C	制造业	284,079,269.46	68.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	368,340,702.09	89.13

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	738,276.00	0.18
C	制造业	12,617,539.71	3.05
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	20,648.04	0.00
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	818,235.64	0.20

	术服务业		
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,404.91	0.00
M	科学研究和技术服务业	46,162.51	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	209,451.74	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	165,485.04	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,628,203.59	3.54

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	002466	天齐锂业	323,400	40,360,320.00	9.77
2	002460	赣锋锂业	261,354	38,863,339.80	9.40
3	601899	紫金矿业	3,135,100	29,250,483.00	7.08
4	603799	华友钴业	280,030	26,776,468.60	6.48
5	600111	北方稀土	616,050	21,660,318.00	5.24
6	002738	中矿资源	191,272	17,713,699.92	4.29
7	603993	洛阳钼业	3,001,700	17,199,741.00	4.16

8	002240	盛新锂能	268,109	16,183,059.24	3.92
9	600392	盛和资源	714,700	16,152,220.00	3.91
10	600547	山东黄金	853,380	15,838,732.80	3.83
11	600219	南山铝业	3,621,900	13,364,811.00	3.23
12	000933	神火股份	921,192	12,049,191.36	2.92
13	000960	锡业股份	628,902	10,546,686.54	2.55
14	000060	中金岭南	2,168,700	9,672,402.00	2.34
15	601600	中国铝业	1,846,600	8,771,350.00	2.12
16	002182	云海金属	329,900	8,273,892.00	2.00
17	000878	云南铜业	665,700	7,582,323.00	1.83
18	600206	有研新材	382,200	7,391,748.00	1.79
19	601168	西部矿业	571,901	6,765,588.83	1.64
20	688122	西部超导	72,205	6,657,301.00	1.61
21	603876	鼎胜新材	118,900	5,374,280.00	1.30
22	601958	金钼股份	597,700	5,283,668.00	1.28
23	000807	云铝股份	529,700	5,233,436.00	1.27
24	002192	融捷股份	23,700	3,642,690.00	0.88
25	600497	驰宏锌锗	674,300	3,499,617.00	0.85
26	002237	恒邦股份	297,400	2,914,520.00	0.71
27	000630	铜陵有色	762,700	2,486,402.00	0.60
28	300034	钢研高纳	49,000	2,066,820.00	0.50
29	601677	明泰铝业	82,000	1,951,600.00	0.47
30	600362	江西铜业	100,700	1,795,481.00	0.43
31	600259	广晟有色	28,800	1,458,720.00	0.35
32	600711	盛屯矿业	92,400	717,024.00	0.17
33	600338	西藏珠峰	20,000	574,000.00	0.14
34	600456	宝钛股份	4,000	237,600.00	0.06
35	000975	银泰黄金	3,200	31,168.00	0.01

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	688388	嘉元科技	65,670	5,573,412.90	1.35
2	688190	云路股份	61,416	4,775,094.00	1.16
3	000762	西藏矿业	13,200	738,276.00	0.18
4	000970	中科三环	21,500	403,770.00	0.10
5	688281	华秦科技	1,515	373,023.30	0.09
6	688045	必易微	3,939	244,139.22	0.06
7	688322	奥比中光	7,610	235,833.90	0.06
8	688207	格灵深瞳	7,514	198,219.32	0.05
9	301139	元道通信	4,973	191,261.58	0.05
10	688209	英集芯	6,231	171,850.98	0.04
11	301175	中科环保	44,798	171,128.36	0.04
12	688400	凌云光	7,278	159,606.54	0.04
13	688125	安达智能	3,585	155,696.55	0.04
14	301239	普瑞眼科	4,502	151,492.30	0.04
15	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.03
16	688225	亚信安全	4,435	93,135.00	0.02
17	688163	赛伦生物	3,607	84,980.92	0.02
18	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
19	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
20	301238	瑞泰新材	1,029	33,000.03	0.01
21	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
22	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.01
23	301263	泰恩康	658	20,648.04	0.00
24	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
25	301268	铭利达	545	19,004.15	0.00
26	301302	华如科技	333	18,787.86	0.00
27	301217	铜冠铜箔	1,245	18,463.35	0.00
28	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
29	301201	诚达药业	252	18,028.08	0.00

30	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
31	301256	华融化学	1,725	17,388.00	0.00
32	301153	中科江南	383	16,844.34	0.00
33	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
34	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
35	301236	软通动力	498	15,627.24	0.00
36	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
37	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
38	301103	何氏眼科	437	13,992.74	0.00
39	301109	军信股份	864	13,944.96	0.00
40	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
41	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
42	301150	中一科技	154	12,745.04	0.00
43	301216	万凯新材	420	12,532.80	0.00
44	301200	大族数控	240	12,460.80	0.00
45	301102	兆讯传媒	399	12,404.91	0.00
46	301206	三元生物	270	12,336.30	0.00
47	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
48	301207	华兰疫苗	214	12,073.88	0.00
49	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
50	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
51	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
52	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
53	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
54	301237	和顺科技	257	10,758.02	0.00
55	301219	腾远钴业	122	10,714.04	0.00
56	301258	富士莱	254	10,586.72	0.00
57	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
58	301151	冠龙节能	450	9,657.00	0.00
59	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
60	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00

61	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
62	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
63	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
64	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
65	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
66	300834	星辉环材	250	7,507.50	0.00
67	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
68	301196	唯科科技	149	5,590.48	0.00
69	688357	建龙微纳	30	3,373.20	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	600111	北方稀土	22,953,089.99	5.47
2	603993	洛阳钼业	21,430,713.00	5.11
3	600547	山东黄金	19,960,002.60	4.76
4	000629	攀钢钒钛	19,153,568.00	4.57
5	000807	云铝股份	19,001,029.85	4.53
6	600497	驰宏锌锗	18,068,446.59	4.31
7	000060	中金岭南	16,704,522.00	3.98
8	600392	盛和资源	16,300,681.41	3.89
9	601600	中国铝业	15,929,007.00	3.80
10	688122	西部超导	15,683,760.62	3.74
11	002466	天齐锂业	13,564,333.00	3.23
12	002182	云海金属	13,345,468.00	3.18
13	601168	西部矿业	12,688,245.59	3.03
14	601677	明泰铝业	12,218,663.82	2.91
15	600489	中金黄金	12,093,296.20	2.88
16	002240	盛新锂能	11,972,506.00	2.85

17	000970	中科三环	11,825,423.80	2.82
18	000933	神火股份	11,773,263.00	2.81
19	601958	金钼股份	11,311,406.40	2.70
20	601899	紫金矿业	10,166,453.00	2.42
21	000657	中钨高新	9,806,933.00	2.34
22	600362	江西铜业	9,487,050.95	2.26
23	000603	盛达资源	9,455,693.63	2.25
24	000878	云南铜业	9,042,537.00	2.16
25	688388	嘉元科技	8,666,766.03	2.07
26	600206	有研新材	8,608,041.87	2.05

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	600111	北方稀土	24,566,721.06	5.86
2	601677	明泰铝业	24,155,488.28	5.76
3	601600	中国铝业	20,129,930.00	4.80
4	000630	铜陵有色	19,225,976.00	4.58
5	600362	江西铜业	19,166,019.50	4.57
6	000629	攀钢钒钛	16,922,582.00	4.03
7	000603	盛达资源	15,006,398.30	3.58
8	000933	神火股份	14,888,783.00	3.55
9	601958	金钼股份	14,595,839.00	3.48
10	600497	驰宏锌锗	14,506,087.00	3.46
11	600549	厦门钨业	14,265,758.27	3.40
12	600456	宝钛股份	13,780,005.00	3.29
13	603799	华友钴业	13,423,458.30	3.20
14	000807	云铝股份	12,981,755.00	3.09
15	002466	天齐锂业	12,396,043.00	2.96

16	002182	云海金属	12,234,367.00	2.92
17	000970	中科三环	12,188,545.50	2.91
18	600489	中金黄金	12,109,404.99	2.89
19	600888	新疆众和	12,074,948.08	2.88
20	601899	紫金矿业	11,912,974.00	2.84
21	601168	西部矿业	11,287,785.00	2.69
22	002240	盛新锂能	11,238,924.95	2.68
23	000975	银泰黄金	10,640,227.60	2.54
24	688122	西部超导	10,344,110.70	2.47
25	002155	湖南黄金	9,460,059.00	2.26
26	600711	盛屯矿业	9,289,686.15	2.21
27	002978	安宁股份	9,026,663.00	2.15

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	506,424,146.69
卖出股票收入（成交）总额	517,542,272.08

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

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投资股指期货。

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投资国债期货。

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

赣锋锂业：2022年7月1日，江西赣锋锂业股份有限公司收到中国证券监督管理委员会的立案告知书。

本基金为指数增强型基金，在有效跟踪标的指数的基础上，结合增强型的主动投资。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。

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	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	3,643,261.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	—
9	合计	3,643,261.10

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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	688281	华秦科技	373,023.30	0.09	科创板新股限售

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。

§ 8 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
东财有色增强A	17,310	7,366.59	10,955,437.64	8.59%	116,560,217.15	91.41%
东财有色	22,189	6,959.43	5,682.74	0.00%	154,417,137.03	100.00%

增强C						
合计	38,726	7,280.34	10,961,120.38	3.89%	270,977,354.18	96.11%

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	东财有色增强A	424.85	0.00%
	东财有色增强C	7,042.88	0.00%
	合计	7,467.73	0.00%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东财有色增强A	0
	东财有色增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东财有色增强A	0
	东财有色增强C	0~10
	合计	0~10

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	10,641,114.41	3.77%	10,000,458.38	3.55%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
基金经理等人员	6,964.27	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	10,648,078.68	3.78%	10,000,458.38	3.55%	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

	东财有色增强A	东财有色增强C
基金合同生效日(2021年03月16日)基金份额总额	95,490,727.94	47,450,791.42
本报告期期初基金份额总额	123,011,514.08	161,798,191.88
本报告期基金总申购份额	72,096,878.70	140,802,261.42
减：本报告期基金总赎回份额	67,592,737.99	148,177,633.53
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	127,515,654.79	154,422,819.77

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。

§ 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，本基金未召开基金份额持有人大会。

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：本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：本报告期内，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变更。

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

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。

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	
招商证券	2	1,007,927,766.63	100.00%	427,777.28	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。

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

无。

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	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与中信证券、中信证券华南、中信证券山东及中信期货认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-20
2	西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金2021年第四季度报告	证监会规定网站	2022-01-21

3	西藏东财基金管理有限公司关于提示投资者持续完善客户身份信息的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-25
4	西藏东财基金管理有限公司关于更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-27
5	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与蚂蚁(杭州)基金销售有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-28
6	关于公司自有资金拟申购旗下权益类公募基金相关事宜的公告	证监会规定报刊和网站	2022-01-29
7	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与上海联泰基金销售有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022-03-11
8	西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金2021年年度报告	证监会规定网站	2022-03-29
9	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与北京雪球基金销售有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022-04-13
10	西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金2022年第一季度报告	证监会规定网站	2022-04-21
11	西藏东财基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“神火股份”股票估值方法的公告	证监会规定报刊和网站	2022-04-30

12	西藏东财基金管理有限公司 关于旗下基金参与浙江同花 顺基金销售有限公司认购、 申购(含定期定额投资)费率 优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022-06-17
----	--	------------	------------

§ 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有色金属指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件

二、《西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金基金合同》

三、《西藏东财中证有色金属指数增强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

二〇二二年八月三十日