

---

# 西藏东财中证 500 指数型发起式证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:西藏东财基金管理有限公司

基金托管人:中国国际金融股份有限公司

送出日期:2023 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。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2023年08月28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2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	71
7.1 期末基金资产组合情况	71
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	72
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	74
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	94
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	96
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	96
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	96
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	96
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	96
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	96
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	96
7.12 投资组合报告附注	96
§8 基金份额持有人信息	98
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	98
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	98

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.....	98
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	99
§9 开放式基金份额变动.....	99
§10 重大事件揭示.....	100
10.1 基金份额持有人大会决议.....	100
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.....	100
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	100
10.4 基金投资策略的改变.....	100
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	100
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.....	100
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	100
10.8 其他重大事件.....	101
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
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.....	102
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	102
§12 备查文件目录.....	102
12.1 备查文件目录.....	102
12.2 存放地点.....	102
12.3 查阅方式.....	102

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金	
基金简称	东财中证500	
基金主代码	010992	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年01月20日	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	中国国际金融股份有限公司	
报告期末基金份额总额	232,940,076.20份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财中证500A	东财中证500C
下属分级基金的交易代码	010992	010993
报告期末下属分级基金的份额总额	149,241,788.74份	83,698,287.46份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争获取与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预

	期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西藏东财基金管理有限公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露负责人	姓名	沙福贵	严格
	联系电话	021-23526999	010-65051166
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	AC_Product@cicc.com.cn
客户服务电话		400-9210-107	010-65353060; 010-65351622
传真		021-23526940	010-65059873
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼2层01室	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	北京市朝阳区建外门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
邮政编码		200030	100004
法定代表人		戴彦	沈如军

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金中期报告备置地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

### 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	东财中证500A	东财中证500C
本期已实现收益	-217,558.83	-361,463.65
本期利润	6,907,985.07	2,862,665.48
加权平均基金份额本期利润	0.0453	0.0415
本期加权平均净值利润率	4.30%	3.98%
本期基金份额净值增长率	4.06%	3.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	5,020,660.49	1,973,238.24
期末可供分配基金份额利润	0.0336	0.0236
期末基金资产净值	154,262,449.23	85,671,525.70
期末基金份额净值	1.0336	1.0236
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.36%	2.36%

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

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东财中证500A

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

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	0.09%	0.90%	-0.77%	0.89%	0.86%	0.01%
过去三个月	-3.57%	0.79%	-5.10%	0.78%	1.53%	0.01%
过去六个月	4.06%	0.75%	2.20%	0.75%	1.86%	0.00%
过去一年	-3.28%	0.91%	-6.65%	0.91%	3.37%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.36%	1.06%	-6.81%	1.07%	10.17%	-0.01%

东财中证500C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.06%	0.90%	-0.77%	0.89%	0.83%	0.01%
过去三个月	-3.66%	0.78%	-5.10%	0.78%	1.44%	0.00%
过去六个月	3.86%	0.75%	2.20%	0.75%	1.66%	0.00%
过去一年	-3.66%	0.91%	-6.65%	0.91%	2.99%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.36%	1.06%	-6.81%	1.07%	9.17%	-0.01%

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



东财中证500A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年01月20日-2023年06月30日)



东财中证500C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年01月20日-2023年06月30日)



注：1、本基金基金合同于2021年1月20日生效。

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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2023年6月30日，公司旗下管理38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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金、西藏东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证云计算与大数据主题指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财创新医疗六个月定期开放混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证芯片产业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、西藏东财品质生活优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财稳健配置六个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、西藏东财中证证券公司30指数型发起式证券投资基金、西藏东财产业优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财时代优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财成长优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财价值启航混合型发起式证券投资基金、西藏东财产业智选混合型发起式证券投资基金、西藏东财远见成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财景气成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金。

**4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介**

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职 日期	离任 日期		
姚楠 燕	本基金基金经理	2021-0 1-20	-	6 年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。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、基金经理兼 基金经理助理兼研究员等 职务。
莫志 刚	本基金基金经理助理	2022-1 0-31	-	10 年	南京大学计算机技术专业 硕士。自2013年4月始，先 后在万家基金管理有限公司、南华基金管理有限公 司、西藏东财基金管理有 限公司担任量化研究员、 基金经理、基金经理兼基 金经理助理等职务。

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

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

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

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，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

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2023年6月30日，东财中证500A份额净值为1.0336元，报告期内基金份额净值增长率为4.06%，东财中证500C份额净值为1.0236元，报告期内基金份额净值增长率为3.86%，同期业绩比较基准收益率为2.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年上半年，宏观经济表现出预期较强，现实稍弱的特征。上半年中国经济曲折修复，一季度经济超预期增长4.5%，然而内生动能稍显不足，二季度修复动能明显放缓。从库存周期视角来看，当前虽然处在从主动去库存向被动去库存切换的转换期，但过程却较为艰难，一是需求动能依然偏弱，二是去库存的驱动力刚从降价转向减产。展望下半年，政策定调扩大内需、提振信心，7月底政治局会议强调“通过终端需求带动有效供给”，意味着政策重心正在从供给端的降本增效转向需求端的扩大内需，中国经济有望延续复苏态势。

证券市场方面，受多重因素影响，上半年A股市场整体呈震荡走势，一季度为震荡上行，二季度为震荡下行。值得一提的是，北向资金表现出韧性，上半年北向资金净买入为2022年全年净买入金额的2倍（数据来源：Choice金融终端），究其原因，或在于国内宏观经济持续修复、流动性合理充裕，国内资本市场总体韧性较强，海外货币政策对国内的扰动较弱，同时A股整体估值处于相对历史低位，配置价值进一步凸显，吸引北向资金流入。展望下半年，在稳增长持续发力的背景下，预计上市公司盈利有望迎来反弹。行业配置方面，目前板块整体估值偏低、行业景气度依然较高，以及符合未来产业转型发展方向的板块值得关注。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元”的披露规定。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的重大违规行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	12,976,194.89	12,681,656.06
结算备付金		-	-

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	227,353,298.83	214,549,149.48
其中：股票投资		227,353,298.83	214,549,149.48
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		14,172.50	-
应收申购款		82,822.67	33,847.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	3,930.87	5,767.69
资产总计		240,430,419.76	227,270,421.00
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		129,287.05	144,253.67
应付管理人报酬		99,029.73	96,640.27
应付托管费		9,902.98	9,664.04
应付销售服务费		28,372.60	21,263.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,258.43	1,359.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	228,594.04	265,412.84
负债合计		496,444.83	538,592.93
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	232,940,076.20	228,779,991.81
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	6,993,898.73	-2,048,163.74
净资产合计		239,933,974.93	226,731,828.07
负债和净资产总计		240,430,419.76	227,270,421.00

注：报告截止日2023年6月30日，东财中证500A基金份额净值人民币1.0336元，基金份额总额149,241,788.74份；东财中证500C基金份额净值人民币1.0236元，基金份额总额83,698,287.46份。基金份额总额合计为232,940,076.20份。

## 6.2 利润表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		10,645,169.93	-28,001,659.93
1.利息收入		349,472.23	36,438.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	32,881.05	36,438.64
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		316,591.18	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-56,030.95	1,927,916.64
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,637,473.64	-753,103.92
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	2,581,442.69	2,681,020.56
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	10,349,673.03	-29,974,662.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,055.62	8,647.62
<b>减：二、营业总支出</b>		874,519.38	922,538.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	576,923.10	621,311.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	57,692.36	62,131.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	142,719.91	140,981.15
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产		-	-

支出			
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1,140.32	-
8. 其他费用	6.4.7.19	96,043.69	98,114.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,770,650.55	-28,924,198.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,770,650.55	-28,924,198.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,770,650.55	-28,924,198.31

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023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）	228,779,991.81	-	-2,048,163.74	226,731,828.07
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）	228,779,991.81	-	-2,048,163.74	226,731,828.07
三、本期增减变	4,160,084.39	-	9,042,062.47	13,202,146.86

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	9,770,650.55	9,770,650.55
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,160,084.39	-	-728,588.08	3,431,496.31
其中：1.基金申购款	43,477,417.40	-	1,461,273.21	44,938,690.61
2.基金赎回款	-39,317,333.01	-	-2,189,861.29	-41,507,194.30
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（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）	232,940,076.20	-	6,993,898.73	239,933,974.93
项目	上年度可比期间			
	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）	242,537,370.03	-	45,372,910.37	287,910,280.40
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）	242,537,370.03	-	45,372,910.37	287,910,280.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,537,922.60	-	-29,766,099.45	-39,304,022.05
（一）、综合收益总额	-	-	-28,924,198.31	-28,924,198.31
（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）	-9,537,922.60	-	-841,901.14	-10,379,823.74
其中：1.基金申购款	61,097,687.14	-	2,887,254.16	63,984,941.30
2.基金赎回款	-70,635,609.74	-	-3,729,155.30	-74,364,765.04
（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）	232,999,447.43	-	15,606,810.92	248,606,258.35

值)				
----	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

沙福贵

侯福岩

陆文澄

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据《西藏东财中证500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或注册上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、

股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金股票资产投资比例为本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表的编制符合企业会计准则以及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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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相一致。

##### 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2023年1月1日至2023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

###### （1）金融资产的分类

根据本基金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，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

## (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用

风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 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基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使



用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。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）。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

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

##### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除权（息）日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

### （3）公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

### （4）信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

### （5）其他收入

在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率在回购期内逐日计提。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期无外币交易。

#### 6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行

业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（3）根据《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

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	5,458,833.96
等于：本金	5,457,708.31
加：应计利息	1,125.65
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	7,517,360.93
等于：本金	7,516,331.97
加：应计利息	1,028.96
减：坏账准备	-

合计	12,976,194.89
----	---------------

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	246,492,031.32	-	227,353,298.83	-19,138,732.49
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	246,492,031.32	-	227,353,298.83	-19,138,732.49

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日

应收利息	-
其他应收款	3,930.87
待摊费用	-
合计	3,930.87

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6.79
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	169,507.37
其他应付	47,179.13
合计	228,594.04

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 东财中证500A

金额单位：人民币元

项目 (东财中证500A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	161,533,776.86	161,533,776.86
本期申购	13,245,216.25	13,245,216.25
本期赎回(以“-”号填列)	-25,537,204.37	-25,537,204.37
本期末	149,241,788.74	149,241,788.74

**6.4.7.7.2 东财中证500C**

金额单位：人民币元

项目 (东财中证500C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,246,214.95	67,246,214.95
本期申购	30,232,201.15	30,232,201.15
本期赎回（以“-”号填列）	-13,780,128.64	-13,780,128.64
本期末	83,698,287.46	83,698,287.46

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

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

单位：人民币元

项目 (东财中证500A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	23,121,338.20	-24,201,194.58	-1,079,856.38
本期利润	-217,558.83	7,125,543.90	6,907,985.07
本期基金份额交易产生的变动数	-1,740,990.44	933,522.24	-807,468.20
其中：基金申购款	1,901,685.93	-1,194,528.09	707,157.84
基金赎回款	-3,642,676.37	2,128,050.33	-1,514,626.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,162,788.93	-16,142,128.44	5,020,660.49

**6.4.7.8.2 东财中证500C**

单位：人民币元

项目 (东财中证500C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	9,046,918.44	-10,015,225.80	-968,307.36
本期利润	-361,463.65	3,224,129.13	2,862,665.48
本期基金份额交易产	2,290,430.88	-2,211,550.76	78,880.12



生的变动数			
其中：基金申购款	4,127,043.18	-3,372,927.81	754,115.37
基金赎回款	-1,836,612.30	1,161,377.05	-675,235.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,975,885.67	-9,002,647.43	1,973,238.24

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	20,465.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12,415.29
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	32,881.05

#### 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
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	52,869,484.13
减：卖出股票成本总额	55,335,473.65
减：交易费用	171,484.12
买卖股票差价收入	-2,637,473.64

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

##### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,581,442.69
其中：证券出借权益补偿收入	226,605.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,581,442.69

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	10,349,673.03
——股票投资	10,349,673.03
——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	10,349,673.03

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	1,979.37
转换费收入	76.25
合计	2,055.62

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 2023年01月01日至2023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	-
汇划手续费	1,558.64
指数使用费	23,076.93
合计	96,043.69

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东财证券	103,793,535.06	100.00%	120,710,013.65	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 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东财证券	108,975.43	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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
东财证券	108,006.58	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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	576,923.10	621,311.92
其中：支付销售机构的客户维护费	261,716.69	295,745.33

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	57,692.36	62,131.19

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财中证500A	东财中证500C	合计
西藏东财基金管理有限公司	0.00	15,375.42	15,375.42
天天基金	0.00	92,165.84	92,165.84
东财证券	0.00	24,322.96	24,322.96
合计	0.00	131,864.22	131,864.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	东财中证500A	东财中证500C	合计
天天基金	0.00	110,393.38	110,393.38

东财证券	0.00	27,639.57	27,639.57
合计	0.00	138,032.95	138,032.95

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

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

单位：人民币元

本期										
2023年01月01日至2023年06月30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	2023061900010600	太极实业	2023-06-19	145,628.00	19,600	14	3.00%	133.54	142,296.00	133.54
东财证券	2023062000022690	卫宁健康	2023-06-20	168,817.00	14,900	14	3.00%	140.70	161,218.00	140.70
东财证券	2023062000022694	国盛金控	2023-06-20	132,440.00	15,400	14	3.00%	110.40	135,212.00	110.40
东财证券	2023062000022696	均胜电子	2023-06-20	230,251.00	12,700	14	3.00%	191.90	224,028.00	191.90
东财证券	202306200002	南网科技	2023-06-20	44,220.00	1,100	14	3.00%	36.90	42,229.00	36.90

	3331									
东财证 券	202306 200002 3370	帝尔激 光	2023-0 6-20	106,14 8.00	1,700	14	3.00%	88.50	110,33 0.00	88.50
东财证 券	202306 200002 3372	新强联	2023-0 6-20	99,06 0.00	2,600	14	3.00%	82.60	97,18 8.00	82.60

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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

东财中证500A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,899,819.83	10,000,458.38
报告期间申购/买入总份额	0.00	899,361.45
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	10,899,819.83	10,899,819.83
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.30%	6.44%

东财中证500C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
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%



例		
---	--	--

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

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

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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中金公司-托管户	5,458,833.96	20,465.76	9,156,389.05	23,800.48
东财证券-证券资金户	7,517,360.93	12,415.29	7,047,145.80	12,638.16

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

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中金公司	002948	青岛银行	配股发行	9,600	30,720.00

注：本基金本报告期内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**

本基金本报告期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2023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
301486	C致尚	2023-06-30	5个交易日	新股未上市	57.66	57.66	1,665	96,003.90	96,003.90	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个交易日	新股未上市	26.68	26.68	3,593	95,861.24	95,861.24	-
301292	C海科	2023-06-29	6个交易日	新股未上市	19.99	19.99	4,115	82,258.85	82,258.85	-
688603	C天承	2023-06-30	6个交易日	新股未上市	55.00	55.00	1,286	70,730.00	70,730.00	-
301202	朗威股份	2023-06-28	5个交易日	新股未上市	25.82	25.82	2,209	57,036.38	57,036.38	-
301261	C恒工	2023-06-29	7个交易日	新股未上市	36.90	36.90	1,494	55,128.60	55,128.60	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301293	三博脑科	2023-04-2	6个月	创业板新	29.60	71.42	230	6,808.00	16,426.60	-

		5		股限售							
301301	川宁生物	2022-12-20	6个月	创业板新股限售	5.00	8.96	1,756	8,780.00	15,733.76	-	
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	创业板新股限售	20.67	26.17	545	11,265.15	14,262.65	-	
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	创业板新股限售	24.80	43.85	322	7,985.60	14,119.70	-	
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	创业板新股限售	76.80	107.95	123	9,446.40	13,277.85	-	
301320	豪江智能	2023-06-01	6个月	创业板新股限售	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-	
301310	鑫宏业	2023-05-26	6个月	创业板新股限售	67.28	65.43	186	12,514.08	12,169.98	-	
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	创业板新股限售	23.77	42.89	283	6,726.91	12,137.87	-	
688629	华丰科技	2023-06-16	6个月	科创板新股限售	9.26	18.59	620	5,741.20	11,525.80	-	

688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	科创板新股限售	32.52	42.37	253	8,227.56	10,719.61	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	科创板新股限售	26.74	40.68	263	7,032.62	10,698.84	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	创业板新股限售	32.29	51.12	207	6,684.03	10,581.84	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	科创板新股限售	12.68	22.31	459	5,820.12	10,240.29	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	科创板新股限售	152.38	135.97	75	11,428.50	10,197.75	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	创业板新股限售	38.13	31.03	321	12,239.73	9,960.63	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	创业板新股限售	26.80	22.32	434	11,631.20	9,686.88	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	创业板新股限售	43.99	51.57	185	8,138.15	9,540.45	-
301307	美利信	2023-04-1	6个月	创业板新	32.34	31.86	298	9,637.32	9,494.28	-

		4		限售						
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	科创板新股限售	43.67	53.05	174	7,598.58	9,230.70	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	创业板新股限售	71.88	92.60	98	7,044.24	9,074.80	-
301387	光大同创	2023-04-10	6个月	创业板新股限售	58.32	45.36	198	11,547.36	8,981.28	-
301383	天键股份	2023-05-31	6个月	创业板新股限售	46.16	35.72	250	11,540.00	8,930.00	-
688620	安凯微	2023-06-15	6个月	科创板新股限售	10.68	12.34	708	7,561.44	8,736.72	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	创业板新股限售	28.75	21.02	411	11,816.25	8,639.22	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	科创板新股限售	75.00	90.76	94	7,050.00	8,531.44	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	科创板新股限售	36.15	38.13	223	8,061.45	8,502.99	-

301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	创业板新股限售	41.20	42.69	198	8,157.60	8,452.62	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6个月	创业板新股限售	50.00	30.71	273	13,650.00	8,383.83	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	创业板新股限售	16.24	16.95	494	8,022.56	8,373.30	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	创业板新股限售	57.88	49.17	168	9,723.84	8,260.56	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6个月	科创板新股限售	39.99	36.71	225	8,997.75	8,259.75	-
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	创业板新股限售	30.22	25.50	323	9,761.06	8,236.50	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	创业板新股限售	23.80	32.84	248	5,902.40	8,144.32	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	创业板新股限售	35.66	33.26	240	8,558.40	7,982.40	-
301295	美硕科技	2023-06-1	6个月	创业板新	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

		9		限售							
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	科创板新股限售	35.00	51.23	150	5,250.00	7,684.50	-	
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	科创板新股限售	21.86	23.85	318	6,951.48	7,584.30	-	
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	科创板新股限售	12.10	12.07	622	7,526.20	7,507.54	-	
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	科创板新股限售	21.17	23.50	304	6,435.68	7,144.00	-	
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	科创板新股限售	19.20	25.53	278	5,337.60	7,097.34	-	
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	创业板新股限售	53.27	40.20	170	9,055.90	6,834.00	-	
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	科创板新股限售	125.80	118.03	57	7,170.60	6,727.71	-	
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	创业板新股限售	33.73	31.85	211	7,117.03	6,720.35	-	

301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	创业板新股限售	24.66	22.51	297	7,324.02	6,685.47	-
300804	广康生化	2023-06-15	6个月	创业板新股限售	42.45	32.97	197	8,362.65	6,495.09	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	创业板新股限售	50.00	48.39	133	6,650.00	6,435.87	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	科创板新股限售	30.26	25.33	254	7,686.04	6,433.82	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	科创板新股限售	26.66	31.50	203	5,411.98	6,394.50	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	创业板新股限售	25.25	19.69	322	8,130.50	6,340.18	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	创业板新股限售	26.35	30.60	206	5,428.10	6,303.60	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	创业板新股限售	72.50	58.42	107	7,757.50	6,250.94	-
301281	科源制药	2023-03-2	6个月	创业板新	44.18	25.10	238	7,510.60	5,973.80	其中68股为锁



		8		限售						定期送 股所得
3011 70	锡南 科技	2023 -06-1 6	6个 月	创业 板新 股限 售	34.00	34.93	169	5,74 6.00	5,90 3.17	-
3011 57	华塑 科技	2023 -03-0 1	6个 月	创业 板新 股限 售	56.50	52.93	111	6,27 1.50	5,87 5.23	-
3013 22	绿通 科技	2023 -02-2 7	6个 月	创业 板新 股限 售	131.1 1	53.24	108	9,43 9.92	5,74 9.92	其中36 股为锁 定期送 股所得
3012 03	国泰 环保	2023 -03-2 8	6个 月	创业 板新 股限 售	46.13	34.40	165	7,61 1.45	5,67 6.00	-
3013 23	新莱 福	2023 -05-2 9	6个 月	创业 板新 股限 售	39.06	39.36	143	5,58 5.58	5,62 8.48	-
6886 31	莱斯 信息	2023 -06-1 9	6个 月	科创 板新 股限 售	25.28	29.87	186	4,70 2.08	5,55 5.82	-
6886 23	二元 科技	2023 -05-3 1	6个 月	科创 板新 股限 售	125.8 8	86.79	60	7,55 2.80	5,20 7.40	-
3013 37	亚华 电子	2023 -05-1 6	6个 月	创业 板新 股限 售	32.60	30.37	171	5,57 4.60	5,19 3.27	-

301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	创业板新股限售	19.99	16.90	298	5,957.02	5,036.20	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股锁定	6.58	7.58	654	4,303.32	4,957.32	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股锁定	28.84	30.78	130	3,749.20	4,001.40	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股锁定	17.80	17.89	220	3,916.00	3,935.80	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	创业板新股限售	73.45	46.64	83	6,096.35	3,871.12	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	10.36	11.84	258	2,672.88	3,054.72	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股锁定	11.66	12.26	223	2,600.18	2,733.98	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股锁定	27.93	33.03	81	2,262.33	2,675.43	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股锁定	20.68	25.49	97	2,005.96	2,472.53	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
0013	南矿	2023	6个	新股	15.38	14.87	134	2,06	1,99	-

60	集团	-03-31	月	锁定				0.92	2.58	
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股锁定	25.98	24.53	79	2,052.42	1,937.87	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股锁定	44.48	39.48	47	2,090.56	1,855.56	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	23,200	148,557.59	161,704.00	-
000540	*ST中天	2023-05-19	终止上市暨摘牌	-	-	-	154,400	389,991.21	-	-

注：本基金截至2023年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000012	南玻 A	2023年07月13日-2023年07月13日	5.96	18,200	108,472.00
2	000021	深科技	2023年07月11日-2023年07月11日	19.99	12,400	247,876.00
3	000027	深圳能源	2023年07月13日-2023年07月13日	6.59	19,000	125,210.00
4	000060	中金岭南	2023年07月13日-2023年07月13日	4.75	34,800	165,300.00
5	000547	航天发展	2023年07月14日-2023年07月14日	10.00	17,000	170,000.00

6	000559	万向钱潮	2023年07月11日-2023年07月11日	5.45	17,600	95,920.00
7	000598	兴蓉环境	2023年07月14日-2023年07月14日	5.43	23,800	129,234.00
8	000629	钒钛股份	2023年07月11日-2023年07月11日	3.91	57,400	224,434.00
9	000709	河钢股份	2023年07月13日-2023年07月13日	2.26	55,000	124,300.00
10	000807	云铝股份	2023年07月11日-2023年07月11日	12.73	17,100	217,683.00
11	000970	中科三环	2023年07月14日-2023年07月14日	12.82	12,900	165,378.00
12	000988	华工科技	2023年07月13日-2023年07月13日	38.01	13,000	494,130.00
13	002030	达安基因	2023年07月11日-2023年07月11日	9.97	13,000	129,610.00
14	002065	东华软件	2023年07月13日-2023年07月13日	7.06	17,100	120,726.00

			23年07月 13日			
15	002131	利欧股份	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	2.30	90,100	207,230.00
16	002152	广电运通	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	11.72	16,500	193,380.00
17	002195	二三四五	2023年07 月14日-20 23年07月 14日	2.89	76,100	219,929.00
18	002249	大洋电机	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	5.70	21,100	120,270.00
19	002281	光迅科技	2023年07 月14日-20 23年07月 14日	37.09	5,200	192,868.00
20	002373	千方科技	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	13.64	14,000	190,960.00
21	002407	多氟多	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	19.86	14,200	282,012.00
22	002463	沪电股份	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	20.94	17,800	372,732.00

23	002497	雅化集团	2023年07月11日-2023年07月11日	17.78	15,300	272,034.00
24	002505	鹏都农牧	2023年07月13日-2023年07月13日	1.89	50,900	96,201.00
25	002506	协鑫集成	2023年07月11日-2023年07月13日	2.93	62,300	182,539.00
26	002531	天顺风能	2023年07月11日-2023年07月11日	15.23	12,000	182,760.00
27	002624	完美世界	2023年07月11日-2023年07月11日	16.89	18,100	305,709.00
28	002670	国盛金控	2023年07月04日-2023年07月04日	8.78	15,400	135,212.00
29	002739	万达电影	2023年07月13日-2023年07月13日	12.54	17,400	218,196.00
30	002745	木林森	2023年07月11日-2023年07月11日	9.20	11,200	103,040.00
31	002958	青农商行	2023年07月11日-2023年07月11日	2.72	51,600	140,352.00

			23年07月 11日			
32	003035	南网能源	2023年07 月14日-20 23年07月 14日	7.12	20,100	143,112.00
33	300001	特锐德	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	20.78	2,000	41,560.00
34	300017	网宿科技	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	7.11	32,500	231,075.00
35	300024	机器人	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	16.67	16,500	275,055.00
36	300026	红日药业	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	5.42	28,000	151,760.00
37	300058	蓝色光标	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	9.67	33,200	321,044.00
38	300088	长信科技	2023年07 月14日-20 23年07月 14日	6.03	21,000	126,630.00
39	300115	长盈精密	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	11.91	11,200	133,392.00



40	300118	东方日升	2023年07月11日-2023年07月11日	25.63	9,100	233,233.00
41	300144	宋城演艺	2023年07月11日-2023年07月11日	12.40	7,600	94,240.00
42	300182	捷成股份	2023年07月11日-2023年07月11日	6.31	28,100	177,311.00
43	300212	易华录	2023年07月11日-2023年07月11日	33.23	5,300	176,119.00
44	300251	光线传媒	2023年07月14日-2023年07月14日	8.09	14,400	116,496.00
45	300253	卫宁健康	2023年07月04日-2023年07月04日	10.82	14,900	161,218.00
46	300296	利亚德	2023年07月14日-2023年07月14日	6.53	17,800	116,234.00
47	300308	中际旭创	2023年07月14日-2023年07月14日	147.45	8,500	1,253,325.00
48	300363	博腾股份	2023年07月11日-2023年07月11日	29.59	3,600	106,524.00

			23年07月 11日			
49	300373	扬杰科技	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	40.57	1,800	73,026.00
50	300383	光环新网	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	10.75	4,300	46,225.00
51	300390	天华新能	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	35.80	7,800	279,240.00
52	300418	昆仑万维	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	40.28	11,100	447,108.00
53	300438	鹏辉能源	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	48.04	4,300	206,572.00
54	300474	景嘉微	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	89.99	2,900	260,971.00
55	300529	健帆生物	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	23.18	6,400	148,352.00
56	300618	寒锐钴业	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	32.41	2,800	90,748.00

57	300741	华宝股份	2023年07月11日-2023年07月11日	21.42	1,500	32,130.00
58	300748	金力永磁	2023年07月14日-2023年07月14日	29.92	3,500	104,720.00
59	300776	帝尔激光	2023年07月04日-2023年07月04日	64.90	1,700	110,330.00
60	300850	新强联	2023年07月04日-2023年07月04日	37.38	2,600	97,188.00
61	300866	安克创新	2023年07月14日-2023年07月14日	87.50	2,200	192,500.00
62	300888	稳健医疗	2023年07月14日-2023年07月14日	41.67	1,000	41,670.00
63	600021	上海电力	2023年07月13日-2023年07月13日	10.77	18,700	201,399.00
64	600032	浙江新能	2023年07月11日-2023年07月11日	12.56	2,800	35,168.00
65	600157	永泰能源	2023年07月13日-2023年07月13日	1.42	295,700	419,894.00

			23年07月 13日			
66	600177	雅戈尔	2023年07 月14日-20 23年07月 14日	6.31	30,800	194,348.00
67	600208	新湖中宝	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	2.48	29,200	72,416.00
68	600339	中油工程	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	4.07	21,200	86,284.00
69	600409	三友化工	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	5.45	16,500	89,925.00
70	600415	小商品城	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	8.53	36,500	311,345.00
71	600482	中国动力	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	23.44	14,400	337,536.00
72	600499	科达制造	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	11.36	18,100	205,616.00
73	600516	方大炭素	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	6.20	37,600	233,120.00

74	600528	中铁工业	2023年07月11日-2023年07月11日	9.88	16,900	166,972.00
75	600535	天士力	2023年07月11日-2023年07月11日	14.51	11,400	165,414.00
76	600556	天下秀	2023年07月11日-2023年07月11日	7.09	14,400	102,096.00
77	600582	天地科技	2023年07月14日-2023年07月14日	5.83	22,000	128,260.00
78	600667	太极实业	2023年07月03日-2023年07月03日	7.26	19,600	142,296.00
79	600699	均胜电子	2023年07月04日-2023年07月04日	17.64	12,700	224,028.00
80	600707	彩虹股份	2023年07月11日-2023年07月11日	4.76	19,100	90,916.00
81	600739	辽宁成大	2023年07月11日-2023年07月11日	13.15	14,200	186,730.00
82	600839	四川长虹	2023年07月11日-2023年07月11日	5.05	49,200	248,460.00

			23年07月 11日			
83	601016	节能风电	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	3.67	51,700	189,739.00
84	601168	西部矿业	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	10.51	16,200	170,262.00
85	601456	国联证券	2023年07 月14日-20 23年07月 14日	9.10	13,100	119,210.00
86	601568	北元集团	2023年07 月04日-20 23年07月 04日	5.27	15,800	83,266.00
87	601611	中国核建	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	8.45	12,000	101,400.00
88	601696	中银证券	2023年07 月14日-20 23年07月 14日	10.66	22,100	235,586.00
89	601778	晶科科技	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	4.94	23,800	117,572.00
90	603000	人民网	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	29.20	7,000	204,400.00

91	603077	和邦生物	2023年07月11日-2023年07月11日	2.43	78,300	190,269.00
92	688006	杭可科技	2023年07月11日-2023年07月11日	30.47	3,200	97,504.00
93	688029	南微医学	2023年07月13日-2023年07月13日	81.56	1,200	97,872.00
94	688099	晶晨股份	2023年07月14日-2023年07月14日	84.32	1,600	134,912.00
95	688107	安路科技	2023年07月11日-2023年07月11日	55.39	1,600	88,624.00
96	688116	天奈科技	2023年07月13日-2023年07月13日	45.75	3,100	141,825.00
97	688208	道通科技	2023年07月11日-2023年07月11日	30.31	3,400	103,054.00
98	688234	天岳先进	2023年07月14日-2023年07月14日	73.94	1,100	81,334.00
99	688248	南网科技	2023年07月04日-2023年07月04日	38.39	1,100	42,229.00

			23年07月 04日			
100	688256	寒武纪	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	188.00	2,700	507,600.00
101	688276	百克生物	2023年07 月14日-20 23年07月 14日	62.60	1,600	100,160.00
102	688385	复旦微电	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	50.10	3,500	175,350.00
103	688390	固德威	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	166.86	1,300	216,918.00
104	688567	孚能科技	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	21.59	11,300	243,967.00
105	688690	纳微科技	2023年07 月13日-20 23年07月 13日	38.85	2,600	101,010.00
106	688777	中控技术	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	62.78	4,300	269,954.00
107	688778	厦钨新能	2023年07 月11日-20 23年07月 11日	49.50	2,200	108,900.00



合计					2,152,000	19,487,94 5.00
----	--	--	--	--	-----------	-------------------

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利

率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	12,976,194.89	-	-	-	12,976,194.89
交易性金融资产	-	-	-	227,353,298.83	227,353,298.83
应收股利	-	-	-	14,172.50	14,172.50
应收申购款	-	-	-	82,822.67	82,822.67
其他资产	-	-	-	3,930.87	3,930.87
资产总计	12,976,194.89	-	-	227,454,224.87	240,430,419.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	129,287.05	129,287.05
应付管理人报酬	-	-	-	99,029.73	99,029.73
应付托管费	-	-	-	9,902.98	9,902.98
应付销售服务费	-	-	-	28,372.60	28,372.60
应交税费	-	-	-	1,258.43	1,258.43
其他负债	-	-	-	228,594.04	228,594.04
负债总计	-	-	-	496,444.83	496,444.83

利率敏 感度缺 口	12,976,194.89	-	-	226,957,780.04	239,933,974.93
上年度 末 2022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	12,681,656.06	-	-	-	12,681,656.06
交易性 金融资 产	-	-	-	214,549,149.48	214,549,149.48
应收申 购款	-	-	-	33,847.77	33,847.77
其他资 产	-	-	-	5,767.69	5,767.69
资产总 计	12,681,656.06	-	-	214,588,764.94	227,270,421.00
负债					
应付赎 回款	-	-	-	144,253.67	144,253.67
应付管 理人报 酬	-	-	-	96,640.27	96,640.27
应付托 管费	-	-	-	9,664.04	9,664.04
应付销 售服务 费	-	-	-	21,263.10	21,263.10
应交税 费	-	-	-	1,359.01	1,359.01
其他负 债	-	-	-	265,412.84	265,412.84
负债总 计	-	-	-	538,592.93	538,592.93
利率敏 感度缺 口	12,681,656.06	-	-	214,050,172.01	226,731,828.07

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022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	227,353,298.83	94.76	214,549,149.48	94.63
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	227,353,298.83	94.76	214,549,149.48	94.63

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	11,868,769.61	11,262,967.59
	业绩比较基准下降5%	-11,868,769.61	-11,262,967.59

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	226,136,135.51	213,011,856.29
第二层次	618,722.97	811,107.00
第三层次	598,440.35	726,186.19

合计	227,353,298.83	214,549,149.48
----	----------------	----------------

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023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（2022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银行存款、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	227,353,298.83	94.56
	其中：股票	227,353,298.83	94.56
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	12,976,194.89	5.40
8	其他各项资产	100,926.04	0.04
9	合计	240,430,419.76	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19,487,945.00元，占基金资产净值比例为8.12%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,581,670.00	0.66
B	采矿业	8,318,800.44	3.47
C	制造业	141,596,660.63	59.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,785,269.70	3.24
E	建筑业	2,510,586.00	1.05
F	批发和零售业	7,128,897.62	2.97
G	交通运输、仓储和邮政业	3,397,584.00	1.42
H	住宿和餐饮业	423,324.05	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,521,496.16	7.72
J	金融业	19,342,634.05	8.06
K	房地产业	3,061,326.00	1.28
L	租赁和商务服务业	2,770,915.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	2,543,002.61	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	1,257,485.40	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-



Q	卫生和社会工作	1,130,171.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	3,191,711.00	1.33
S	综合	1,189,223.00	0.50
	合计	225,750,756.66	94.09

### 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	363.20	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,103,827.34	0.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	5,109.49	0.00
F	批发和零售业	32,841.21	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	354.40	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,226.25	0.05
J	金融业	38.30	0.00
K	房地产业	268,891.73	0.11
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	12,016.18	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,426.60	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,602,542.17	0.67

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 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	300308	中际旭创	21,300	3,140,685.00	1.31
2	688256	寒武纪	6,859	1,289,492.00	0.54
3	000988	华工科技	33,400	1,269,534.00	0.53
4	002340	格林美	170,700	1,179,537.00	0.49
5	002384	东山精密	45,500	1,178,450.00	0.49
6	002422	科伦药业	39,100	1,160,488.00	0.48
7	600372	中航电子	74,500	1,130,910.00	0.47
8	300418	昆仑万维	27,800	1,119,784.00	0.47
9	300012	华测检测	55,900	1,090,050.00	0.45
10	600157	永泰能源	738,400	1,048,528.00	0.44
11	300724	捷佳伟创	9,300	1,044,855.00	0.44
12	600079	人福医药	38,000	1,023,720.00	0.43
13	600489	中金黄金	96,700	998,911.00	0.42
14	300003	乐普医疗	43,800	990,318.00	0.41
15	688777	中控技术	15,731	987,592.18	0.41
16	002738	中矿资源	18,980	966,841.20	0.40
17	600487	亨通光电	65,600	961,696.00	0.40
18	002028	思源电气	20,400	953,088.00	0.40
19	600536	中国软件	20,019	938,490.72	0.39
20	002463	沪电股份	44,300	927,642.00	0.39
21	601058	赛轮轮胎	81,382	926,940.98	0.39
22	601555	东吴证券	133,160	924,130.40	0.39

23	600765	中航重机	34,260	908,232.60	0.38
24	300037	新宙邦	17,340	899,772.60	0.38
25	000066	中国长城	64,300	889,269.00	0.37
26	600885	宏发股份	27,680	881,608.00	0.37
27	000807	云铝股份	69,200	880,916.00	0.37
28	600482	中国动力	35,900	841,496.00	0.35
29	000009	中国宝安	68,600	828,002.00	0.35
30	688099	晶晨股份	9,718	819,421.76	0.34
31	300146	汤臣倍健	33,900	812,922.00	0.34
32	000423	东阿阿胶	15,200	812,440.00	0.34
33	600352	浙江龙盛	86,500	808,775.00	0.34
34	300058	蓝色光标	82,800	800,676.00	0.33
35	002966	苏州银行	121,870	798,248.50	0.33
36	002156	通富微电	35,200	795,520.00	0.33
37	002185	华天科技	85,200	783,840.00	0.33
38	601108	财通证券	108,000	781,920.00	0.33
39	600415	小商品城	91,200	777,936.00	0.32
40	002625	光启技术	50,100	764,526.00	0.32
41	002624	完美世界	45,100	761,739.00	0.32
42	600027	华电国际	113,100	756,639.00	0.32
43	300144	宋城演艺	60,800	753,920.00	0.31
44	600109	国金证券	86,600	750,822.00	0.31
45	000783	长江证券	128,700	746,460.00	0.31
46	600988	赤峰黄金	55,339	744,862.94	0.31
47	600161	天坛生物	27,400	743,910.00	0.31
48	601233	桐昆股份	56,100	743,325.00	0.31
49	601077	渝农商行	205,700	738,463.00	0.31
50	002008	大族激光	28,000	733,600.00	0.31
51	300568	星源材质	42,600	732,294.00	0.31
52	300285	国瓷材料	26,700	731,580.00	0.30
53	600418	江淮汽车	58,100	731,479.00	0.30

54	600298	安琪酵母	20,174	730,500.54	0.30
55	600096	云天化	42,700	728,889.00	0.30
56	002385	大北农	110,000	726,000.00	0.30
57	002223	鱼跃医疗	20,000	719,800.00	0.30
58	002407	多氟多	35,640	707,810.40	0.30
59	000630	铜陵有色	244,900	707,761.00	0.29
60	600862	中航高科	27,800	703,618.00	0.29
61	603882	金城医学	9,300	702,150.00	0.29
62	300390	天华新能	19,530	699,174.00	0.29
63	002409	雅克科技	9,500	692,360.00	0.29
64	603444	吉比特	1,400	687,554.00	0.29
65	300024	机器人	41,200	686,804.00	0.29
66	601162	天风证券	230,400	686,592.00	0.29
67	603688	石英股份	6,000	683,040.00	0.28
68	000933	神火股份	52,400	681,200.00	0.28
69	002497	雅化集团	38,300	680,974.00	0.28
70	300073	当升科技	13,500	679,455.00	0.28
71	300474	景嘉微	7,550	679,424.50	0.28
72	002240	盛新锂能	21,200	675,644.00	0.28
73	600705	中航产融	176,100	674,463.00	0.28
74	300395	菲利华	13,700	674,040.00	0.28
75	300604	长川科技	14,100	669,609.00	0.28
76	601168	西部矿业	63,400	666,334.00	0.28
77	002439	启明星辰	22,200	660,672.00	0.28
78	605358	立昂微	17,984	660,552.32	0.28
79	000932	华菱钢铁	137,800	657,306.00	0.27
80	600066	宇通客车	44,100	650,034.00	0.27
81	603596	伯特利	8,200	649,932.00	0.27
82	000975	银泰黄金	55,400	648,180.00	0.27
83	002600	领益智造	93,600	646,776.00	0.27
84	300136	信维通信	32,200	646,576.00	0.27

85	600060	海信视像	26,100	645,975.00	0.27
86	002138	顺络电子	26,800	640,788.00	0.27
87	002797	第一创业	111,700	638,924.00	0.27
88	002568	百润股份	17,500	636,125.00	0.27
89	002465	海格通信	61,300	633,842.00	0.26
90	603816	顾家家居	16,400	625,660.00	0.26
91	000021	深科技	31,100	621,689.00	0.26
92	002850	科达利	4,700	621,575.00	0.26
93	601128	常熟银行	91,100	621,302.00	0.26
94	603939	益丰药房	16,760	620,120.00	0.26
95	600839	四川长虹	122,700	619,635.00	0.26
96	600160	巨化股份	44,900	618,722.00	0.26
97	600563	法拉电子	4,500	617,850.00	0.26
98	300253	卫宁健康	57,100	617,822.00	0.26
99	000591	太阳能	90,900	616,302.00	0.26
100	600879	航天电子	72,300	613,827.00	0.26
101	300832	新产业	10,400	613,600.00	0.26
102	600873	梅花生物	68,500	611,705.00	0.25
103	688567	孚能科技	28,235	609,593.65	0.25
104	000683	远兴能源	84,300	606,117.00	0.25
105	688169	石头科技	1,875	601,275.00	0.25
106	601990	南京证券	73,500	601,230.00	0.25
107	600392	盛和资源	46,600	599,742.00	0.25
108	688521	芯原股份	8,329	599,021.68	0.25
109	300699	光威复材	19,380	597,873.00	0.25
110	002368	太极股份	14,465	595,524.05	0.25
111	002078	太阳纸业	55,700	595,433.00	0.25
112	300866	安克创新	6,800	595,000.00	0.25
113	600497	驰宏锌锗	118,400	594,368.00	0.25
114	603589	口子窖	12,000	592,200.00	0.25
115	601696	中银证券	55,400	590,564.00	0.25

116	000729	燕京啤酒	46,800	583,596.00	0.24
117	600177	雅戈尔	92,300	582,413.00	0.24
118	300118	东方日升	22,700	581,801.00	0.24
119	600516	方大炭素	93,700	580,940.00	0.24
120	002025	航天电器	9,100	580,580.00	0.24
121	000831	中国稀土	19,600	580,160.00	0.24
122	002294	信立泰	18,500	577,015.00	0.24
123	300017	网宿科技	81,000	575,910.00	0.24
124	600141	兴发集团	25,900	575,498.00	0.24
125	688390	固德威	3,437	573,497.82	0.24
126	600642	申能股份	81,600	570,384.00	0.24
127	000728	国元证券	87,000	567,240.00	0.24
128	002673	西部证券	89,100	565,785.00	0.24
129	002430	杭氧股份	16,400	563,504.00	0.23
130	600699	均胜电子	31,800	560,952.00	0.23
131	000629	钒钛股份	143,000	559,130.00	0.23
132	600170	上海建工	206,700	556,023.00	0.23
133	002532	天山铝业	92,800	555,872.00	0.23
134	600118	中国卫星	19,700	555,737.00	0.23
135	600325	华发股份	56,300	554,555.00	0.23
136	002273	水晶光电	46,230	551,986.20	0.23
137	002195	二三四五	190,300	549,967.00	0.23
138	002268	电科网安	19,700	549,039.00	0.23
139	002739	万达电影	43,500	545,490.00	0.23
140	600521	华海药业	29,600	544,936.00	0.23
141	600153	建发股份	49,900	544,409.00	0.23
142	601966	玲珑轮胎	24,500	544,390.00	0.23
143	002372	伟星新材	26,500	544,310.00	0.23
144	600166	福田汽车	159,600	542,640.00	0.23
145	600486	扬农化工	6,200	542,004.00	0.23
146	000400	许继电气	23,500	541,675.00	0.23

147	600143	金发科技	61,800	539,514.00	0.22
148	688072	拓荆科技	1,266	539,278.02	0.22
149	600549	厦门钨业	28,300	538,549.00	0.22
150	300595	欧普康视	17,800	537,382.00	0.22
151	603000	人民网	18,400	537,280.00	0.22
152	000998	隆平高科	35,000	537,250.00	0.22
153	688002	睿创微纳	11,937	534,777.60	0.22
154	600399	抚顺特钢	52,400	534,480.00	0.22
155	000738	航发控制	21,900	534,360.00	0.22
156	600637	东方明珠	68,100	532,542.00	0.22
157	689009	九号公司	14,340	528,429.00	0.22
158	002065	东华软件	74,600	526,676.00	0.22
159	688220	翱捷科技	6,977	525,996.03	0.22
160	002444	巨星科技	24,000	525,120.00	0.22
161	300487	蓝晓科技	8,400	524,328.00	0.22
162	688536	思瑞浦	2,400	523,200.00	0.22
163	600859	王府井	26,400	522,456.00	0.22
164	600481	双良节能	37,300	521,454.00	0.22
165	601577	长沙银行	66,800	518,368.00	0.22
166	000997	新大陆	27,400	517,860.00	0.22
167	601198	东兴证券	64,500	517,290.00	0.22
168	002131	利欧股份	224,500	516,350.00	0.22
169	002353	杰瑞股份	20,500	515,165.00	0.21
170	600499	科达制造	45,300	514,608.00	0.21
171	300438	鹏辉能源	10,700	514,028.00	0.21
172	300383	光环新网	47,800	513,850.00	0.21
173	600704	物产中大	103,600	511,784.00	0.21
174	000960	锡业股份	32,800	510,040.00	0.21
175	300682	朗新科技	21,900	509,832.00	0.21
176	600271	航天信息	36,900	505,161.00	0.21
177	600021	上海电力	46,800	504,036.00	0.21

178	000519	中兵红箭	27,800	502,902.00	0.21
179	300001	特锐德	24,200	502,876.00	0.21
180	002373	千方科技	36,800	501,952.00	0.21
181	601997	贵阳银行	97,200	501,552.00	0.21
182	603077	和邦生物	205,500	499,365.00	0.21
183	688009	中国通号	85,875	498,075.00	0.21
184	300676	华大基因	8,300	497,917.00	0.21
185	000623	吉林敖东	30,900	495,636.00	0.21
186	000703	恒逸石化	73,100	495,618.00	0.21
187	002507	涪陵榨菜	26,880	492,172.80	0.21
188	300088	长信科技	81,600	492,048.00	0.21
189	002056	横店东磁	27,000	491,670.00	0.20
190	600380	健康元	38,500	489,335.00	0.20
191	688516	奥特维	2,582	486,448.80	0.20
192	000513	丽珠集团	12,500	486,375.00	0.20
193	600511	国药股份	12,500	485,625.00	0.20
194	600867	通化东宝	46,400	484,416.00	0.20
195	002152	广电运通	41,300	484,036.00	0.20
196	600498	烽火通信	23,700	482,769.00	0.20
197	002281	光迅科技	13,000	482,170.00	0.20
198	600998	九州通	46,439	482,036.82	0.20
199	600529	山东药玻	17,600	479,072.00	0.20
200	600546	山煤国际	32,900	476,063.00	0.20
201	002203	海亮股份	39,600	475,596.00	0.20
202	002299	圣农发展	24,800	474,920.00	0.20
203	600348	华阳股份	59,950	474,204.50	0.20
204	601016	节能风电	129,110	473,833.70	0.20
205	000636	风华高科	30,800	472,472.00	0.20
206	603338	浙江鼎力	8,400	470,484.00	0.20
207	600739	辽宁成大	35,600	468,140.00	0.20
208	603517	绝味食品	12,600	468,090.00	0.20



209	002595	豪迈科技	13,300	467,229.00	0.19
210	688301	奕瑞科技	1,651	466,291.93	0.19
211	603712	七一二	15,400	465,234.00	0.19
212	601636	旗滨集团	53,500	461,170.00	0.19
213	002192	融捷股份	6,900	461,127.00	0.19
214	603737	三棵树	7,000	457,940.00	0.19
215	002080	中材科技	22,300	457,596.00	0.19
216	002531	天顺风能	30,000	456,900.00	0.19
217	002506	协鑫集成	155,600	455,908.00	0.19
218	603927	中科软	11,820	455,779.20	0.19
219	002432	九安医疗	12,900	454,209.00	0.19
220	603885	吉祥航空	29,400	453,642.00	0.19
221	688772	珠海冠宇	22,455	452,468.25	0.19
222	600863	内蒙华电	108,500	450,275.00	0.19
223	600970	中材国际	35,100	447,525.00	0.19
224	600580	卧龙电驱	30,600	447,066.00	0.19
225	688385	复旦微电	8,879	444,837.90	0.19
226	600655	豫园股份	64,800	444,528.00	0.19
227	002092	中泰化学	68,900	444,405.00	0.19
228	300182	捷成股份	70,100	442,331.00	0.18
229	000878	云南铜业	40,000	442,000.00	0.18
230	300212	易华录	13,300	441,959.00	0.18
231	300296	利亚德	67,300	439,469.00	0.18
232	600820	隧道股份	73,100	439,331.00	0.18
233	002683	广东宏大	14,900	438,656.00	0.18
234	600528	中铁工业	44,300	437,684.00	0.18
235	600909	华安证券	93,640	437,298.80	0.18
236	002939	长城证券	53,600	435,768.00	0.18
237	002926	华西证券	52,300	434,613.00	0.18
238	600535	天士力	29,900	433,849.00	0.18
239	300244	迪安诊断	16,700	428,021.00	0.18

240	600329	达仁堂	9,500	426,455.00	0.18
241	000547	航天发展	42,500	425,000.00	0.18
242	300748	金力永磁	14,200	424,864.00	0.18
243	000750	国海证券	126,700	424,445.00	0.18
244	000893	亚钾国际	18,500	424,390.00	0.18
245	603233	大参林	15,120	423,511.20	0.18
246	600258	首旅酒店	22,339	423,324.05	0.18
247	000039	中集集团	61,200	421,668.00	0.18
248	600008	首创环保	146,400	421,632.00	0.18
249	603160	汇顶科技	9,100	420,875.00	0.18
250	600416	湘电股份	22,000	419,980.00	0.18
251	002557	洽洽食品	10,100	419,655.00	0.17
252	603156	养元饮品	16,822	415,503.40	0.17
253	000970	中科三环	32,320	414,342.40	0.17
254	002429	兆驰股份	75,200	413,600.00	0.17
255	000060	中金岭南	87,000	413,250.00	0.17
256	688200	华峰测控	2,698	412,794.00	0.17
257	601991	大唐发电	123,600	409,116.00	0.17
258	603456	九洲药业	14,900	407,962.00	0.17
259	603893	瑞芯微	5,600	407,960.00	0.17
260	000830	鲁西化工	38,300	404,448.00	0.17
261	603658	安图生物	7,800	403,494.00	0.17
262	600369	西南证券	110,400	402,960.00	0.17
263	600390	五矿资本	74,700	401,886.00	0.17
264	600435	北方导航	34,800	399,852.00	0.17
265	002508	老板电器	15,800	399,582.00	0.17
266	002500	山西证券	71,600	399,528.00	0.17
267	300558	贝达药业	8,300	398,649.00	0.17
268	600398	海澜之家	57,400	394,912.00	0.16
269	002128	电投能源	29,800	393,956.00	0.16
270	002936	郑州银行	170,890	393,047.00	0.16

271	601880	辽港股份	250,300	390,468.00	0.16
272	600038	中直股份	9,800	390,236.00	0.16
273	300009	安科生物	38,940	389,400.00	0.16
274	300070	碧水源	72,300	387,528.00	0.16
275	601717	郑煤机	30,700	382,215.00	0.16
276	002153	石基信息	27,244	381,416.00	0.16
277	600985	淮北矿业	33,000	380,160.00	0.16
278	600848	上海临港	31,800	380,010.00	0.16
279	300026	红日药业	69,900	378,858.00	0.16
280	603858	步长制药	18,400	378,856.00	0.16
281	000050	深天马 A	40,800	374,544.00	0.16
282	300529	健帆生物	16,100	373,198.00	0.16
283	002572	索菲亚	21,200	369,304.00	0.15
284	601179	中国西电	68,100	368,421.00	0.15
285	688188	柏楚电子	1,948	367,314.88	0.15
286	603127	昭衍新药	8,940	365,646.00	0.15
287	002244	滨江集团	41,400	365,148.00	0.15
288	300373	扬杰科技	9,000	365,130.00	0.15
289	601456	国联证券	39,700	361,270.00	0.15
290	600673	东阳光	50,100	361,221.00	0.15
291	002408	齐翔腾达	56,640	360,796.80	0.15
292	688779	长远锂科	31,979	360,403.33	0.15
293	002266	浙富控股	87,100	359,723.00	0.15
294	601958	金钼股份	32,200	359,030.00	0.15
295	003035	南网能源	50,400	358,848.00	0.15
296	600895	张江高科	25,700	357,744.00	0.15
297	600566	济川药业	12,300	357,192.00	0.15
298	600827	百联股份	26,700	356,979.00	0.15
299	002019	亿帆医药	24,400	356,240.00	0.15
300	600667	太极实业	49,000	355,740.00	0.15
301	688116	天奈科技	7,757	354,882.75	0.15

302	000155	川能动力	24,500	352,800.00	0.15
303	603267	鸿远电子	5,400	352,620.00	0.15
304	688538	和辉光电	138,489	351,762.06	0.15
305	002958	青农商行	129,300	351,696.00	0.15
306	600208	新湖中宝	141,400	350,672.00	0.15
307	300357	我武生物	10,406	349,953.78	0.15
308	601666	平煤股份	46,200	348,348.00	0.15
309	601000	唐山港	98,500	347,705.00	0.14
310	000739	普洛药业	19,600	347,704.00	0.14
311	600282	南钢股份	102,500	345,425.00	0.14
312	600171	上海贝岭	18,900	344,925.00	0.14
313	000887	中鼎股份	26,300	344,267.00	0.14
314	600755	厦门国贸	44,300	342,882.00	0.14
315	600378	昊华科技	9,100	342,524.00	0.14
316	002155	湖南黄金	28,000	341,600.00	0.14
317	002670	国盛金控	38,600	338,908.00	0.14
318	300677	英科医疗	15,340	337,480.00	0.14
319	600959	江苏有线	99,700	336,986.00	0.14
320	600316	洪都航空	14,300	335,335.00	0.14
321	300115	长盈精密	27,980	333,241.80	0.14
322	601231	环旭电子	22,000	329,120.00	0.14
323	600315	上海家化	11,300	327,813.00	0.14
324	300888	稳健医疗	7,860	327,526.20	0.14
325	002487	大金重工	10,600	326,904.00	0.14
326	002030	达安基因	32,640	325,420.80	0.14
327	601866	中远海发	131,600	325,052.00	0.14
328	600517	国网英大	57,000	324,900.00	0.14
329	000778	新兴铸管	79,600	324,768.00	0.14
330	603218	日月股份	17,100	324,729.00	0.14
331	000598	兴蓉环境	59,500	323,085.00	0.13
332	600131	国网信通	16,000	323,040.00	0.13

333	300363	博腾股份	10,900	322,531.00	0.13
334	600056	中国医药	24,820	322,163.60	0.13
335	600582	天地科技	55,000	320,650.00	0.13
336	603026	胜华新材	5,400	319,950.00	0.13
337	688082	盛美上海	2,893	319,387.20	0.13
338	000987	越秀资本	50,040	317,754.00	0.13
339	002221	东华能源	36,700	317,455.00	0.13
340	002249	大洋电机	55,400	315,780.00	0.13
341	300251	光线传媒	39,000	315,510.00	0.13
342	600598	北大荒	23,600	314,588.00	0.13
343	000027	深圳能源	47,400	312,366.00	0.13
344	601005	重庆钢铁	222,800	311,920.00	0.13
345	002326	永太科技	20,400	311,916.00	0.13
346	000709	河钢股份	137,460	310,659.60	0.13
347	600906	财达证券	43,100	310,320.00	0.13
348	002518	科士达	7,700	308,077.00	0.13
349	002183	怡亚通	60,400	308,040.00	0.13
350	601106	中国一重	91,200	306,432.00	0.13
351	002831	裕同科技	12,400	302,436.00	0.13
352	601992	金隅集团	138,600	302,148.00	0.13
353	002690	美亚光电	11,710	301,532.50	0.13
354	600718	东软集团	28,200	300,612.00	0.13
355	600373	中文传媒	22,500	299,700.00	0.12
356	000883	湖北能源	65,500	298,680.00	0.12
357	601665	齐鲁银行	76,100	298,312.00	0.12
358	300776	帝尔激光	4,580	297,242.00	0.12
359	603568	伟明环保	16,940	296,619.40	0.12
360	002511	中顺洁柔	26,600	296,590.00	0.12
361	000825	太钢不锈	76,200	294,894.00	0.12
362	601778	晶科科技	59,300	292,942.00	0.12
363	002985	北摩高科	6,578	290,221.36	0.12

364	603883	老百姓	9,720	290,142.00	0.12
365	603228	景旺电子	11,300	289,845.00	0.12
366	601928	凤凰传媒	25,400	289,560.00	0.12
367	600663	陆家嘴	29,200	288,204.00	0.12
368	600967	内蒙一机	28,300	285,830.00	0.12
369	600737	中粮糖业	35,500	285,775.00	0.12
370	688281	华秦科技	1,392	281,880.00	0.12
371	603225	新凤鸣	25,400	280,670.00	0.12
372	600155	华创云信	45,100	280,522.00	0.12
373	600297	广汇汽车	134,800	280,384.00	0.12
374	600801	华新水泥	22,600	279,110.00	0.12
375	002791	坚朗五金	4,300	278,253.00	0.12
376	688778	厦钨新能	5,615	277,942.50	0.12
377	300861	美畅股份	6,400	277,568.00	0.12
378	601098	中南传媒	23,900	277,240.00	0.12
379	603529	爱玛科技	8,600	277,092.00	0.12
380	300482	万孚生物	10,390	276,685.70	0.12
381	002468	申通快递	25,400	274,828.00	0.11
382	688208	道通科技	9,045	274,153.95	0.11
383	002745	木林森	29,600	272,320.00	0.11
384	000012	南玻 A	45,600	271,776.00	0.11
385	001227	兰州银行	94,600	270,556.00	0.11
386	002032	苏泊尔	5,400	270,000.00	0.11
387	603866	桃李面包	26,598	269,171.76	0.11
388	000156	华数传媒	30,800	267,960.00	0.11
389	600871	石化油服	135,300	267,894.00	0.11
390	600500	中化国际	47,700	265,212.00	0.11
391	000581	威孚高科	16,700	263,025.00	0.11
392	688690	纳微科技	6,736	261,693.60	0.11
393	000401	冀东水泥	35,300	260,161.00	0.11
394	301029	怡合达	5,800	259,144.00	0.11

395	002867	周大生	14,550	258,699.00	0.11
396	688276	百克生物	4,132	258,663.20	0.11
397	002250	联化科技	24,500	256,270.00	0.11
398	600556	天下秀	36,000	255,240.00	0.11
399	601118	海南橡胶	56,900	254,912.00	0.11
400	601611	中国核建	30,100	254,345.00	0.11
401	688029	南微医学	3,117	254,222.52	0.11
402	688520	神州细胞	4,457	252,890.18	0.11
403	600022	山东钢铁	177,800	252,476.00	0.11
404	000930	中粮科技	31,000	251,100.00	0.10
405	000785	居然之家	65,100	248,031.00	0.10
406	002010	传化智联	46,600	247,912.00	0.10
407	300850	新强联	6,600	246,708.00	0.10
408	688006	杭可科技	8,055	245,435.85	0.10
409	002423	中粮资本	30,600	244,800.00	0.10
410	601598	中国外运	52,400	244,184.00	0.10
411	601608	中信重工	57,700	242,917.00	0.10
412	600259	广晟有色	6,700	242,138.00	0.10
412	600062	华润双鹤	13,900	242,138.00	0.10
414	002505	鹏都农牧	127,100	240,219.00	0.10
415	000559	万向钱潮	43,900	239,255.00	0.10
416	002081	金螳螂	53,000	239,030.00	0.10
417	600597	光明乳业	22,900	238,160.00	0.10
418	000089	深圳机场	34,100	236,995.00	0.10
419	600782	新钢股份	63,608	235,985.68	0.10
420	603826	坤彩科技	4,700	235,000.00	0.10
421	300618	寒锐钴业	7,200	233,352.00	0.10
422	000958	电投产融	53,700	232,521.00	0.10
423	603638	艾迪精密	11,200	229,824.00	0.10
424	600901	江苏金租	55,640	229,793.20	0.10
425	688052	纳芯微	1,437	227,577.69	0.09

426	600707	彩虹股份	47,700	227,052.00	0.09
427	600339	中油工程	55,700	226,699.00	0.09
428	000937	冀中能源	35,200	224,576.00	0.09
429	600409	三友化工	41,200	224,540.00	0.09
430	600095	湘财股份	28,500	222,300.00	0.09
431	688107	安路科技	4,004	221,781.56	0.09
432	000898	鞍钢股份	79,700	221,566.00	0.09
433	601187	厦门银行	43,900	220,378.00	0.09
434	002761	浙江建投	14,400	218,592.00	0.09
435	603707	健友股份	16,169	218,281.50	0.09
436	000537	广宇发展	18,600	217,062.00	0.09
437	601718	际华集团	73,000	216,810.00	0.09
438	000415	渤海租赁	102,800	215,880.00	0.09
439	600507	方大特钢	46,547	215,512.61	0.09
440	000967	盈峰环境	42,300	213,615.00	0.09
441	001914	招商积余	14,100	212,205.00	0.09
442	688234	天岳先进	2,867	211,985.98	0.09
443	600167	联美控股	30,400	211,888.00	0.09
444	601568	北元集团	39,560	208,481.20	0.09
445	600968	海油发展	67,600	207,532.00	0.09
446	000563	陕国投 A	67,943	207,226.15	0.09
447	600808	马钢股份	80,300	206,371.00	0.09
448	601156	东航物流	15,800	205,400.00	0.09
449	002925	盈趣科技	10,400	201,760.00	0.08
450	300257	开山股份	13,200	200,244.00	0.08
451	600195	中牧股份	17,000	198,560.00	0.08
452	002705	新宝股份	11,000	198,330.00	0.08
453	600126	杭钢股份	44,900	194,866.00	0.08
454	300442	润泽科技	6,300	193,788.00	0.08
455	603650	彤程新材	5,900	193,520.00	0.08
456	600764	中国海防	7,100	193,262.00	0.08



457	603379	三美股份	8,100	190,431.00	0.08
458	002608	江苏国信	25,100	190,007.00	0.08
459	688185	康希诺	2,312	188,428.00	0.08
460	000959	首钢股份	52,000	182,000.00	0.08
461	000402	金融街	39,700	179,444.00	0.07
462	603786	科博达	2,700	177,390.00	0.07
463	002653	海思科	7,400	174,640.00	0.07
464	601828	美凯龙	36,000	172,440.00	0.07
465	002110	三钢闽光	40,700	171,754.00	0.07
466	002563	森马服饰	26,900	167,318.00	0.07
467	688819	天能股份	4,537	167,143.08	0.07
468	001203	大中矿业	15,000	166,650.00	0.07
469	688289	圣湘生物	9,815	165,284.60	0.07
470	600377	宁沪高速	16,500	162,195.00	0.07
471	601228	广州港	50,100	161,823.00	0.07
472	601298	青岛港	23,200	161,704.00	0.07
473	600927	永安期货	9,700	157,722.00	0.07
474	603056	德邦股份	10,200	157,284.00	0.07
475	600623	华谊集团	25,100	156,373.00	0.07
476	000031	大悦城	42,700	156,282.00	0.07
477	600928	西安银行	44,300	155,936.00	0.06
478	603317	天味食品	10,608	154,982.88	0.06
479	601869	长飞光纤	4,100	151,741.00	0.06
480	600350	山东高速	22,500	143,325.00	0.06
481	002399	海普瑞	12,400	142,228.00	0.06
482	601136	首创证券	10,000	141,700.00	0.06
483	601139	深圳燃气	19,100	139,239.00	0.06
484	000869	张裕 A	4,500	137,970.00	0.06
485	601969	海南矿业	20,300	133,574.00	0.06
486	001872	招商港口	7,700	132,979.00	0.06
487	600995	南网储能	11,700	128,817.00	0.05

488	002945	华林证券	9,000	123,120.00	0.05
489	000553	安道麦A	14,500	122,380.00	0.05
490	688105	诺唯赞	4,003	122,051.47	0.05
491	688248	南网科技	2,826	108,490.14	0.05
492	600299	安迪苏	13,400	106,798.00	0.04
493	601158	重庆水务	19,100	106,196.00	0.04
494	603868	飞科电器	1,600	100,944.00	0.04
495	688295	中复神鹰	2,702	99,109.36	0.04
496	603355	莱克电气	3,780	96,049.80	0.04
497	600032	浙江新能	7,200	90,432.00	0.04
498	600956	新天绿能	10,100	88,072.00	0.04
499	300741	华宝股份	4,100	87,822.00	0.04
500	002901	大博医疗	1,900	59,052.00	0.02

### 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	000656	金科股份	147,200	163,392.00	0.07
2	688237	超卓航科	2,402	115,968.56	0.05
3	002146	荣盛发展	68,400	105,336.00	0.04
4	301486	C致尚	1,665	96,003.90	0.04
5	301395	仁信新材	3,593	95,861.24	0.04
6	301292	C海科	4,115	82,258.85	0.03
7	688603	C天承	1,286	70,730.00	0.03
8	688171	纬德信息	2,821	68,945.24	0.03
9	301202	朗威股份	2,209	57,036.38	0.02
10	301261	C恒工	1,494	55,128.60	0.02
11	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
12	300953	震裕科技	240	17,671.20	0.01
13	301293	三博脑科	230	16,426.60	0.01

14	301301	川宁生物	1,756	15,733.76	0.01
15	301317	鑫磊股份	545	14,262.65	0.01
16	301419	阿莱德	322	14,119.70	0.01
17	301325	曼恩斯特	123	13,277.85	0.01
18	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.01
19	301015	百洋医药	462	12,825.12	0.01
20	301310	鑫宏业	186	12,169.98	0.01
21	301358	湖南裕能	283	12,137.87	0.01
22	301048	金鹰重工	843	11,776.71	0.00
23	688629	华丰科技	620	11,525.80	0.00
24	688478	晶升股份	253	10,719.61	0.00
25	688582	芯动联科	263	10,698.84	0.00
26	301315	威士顿	207	10,581.84	0.00
27	688562	航天软件	459	10,240.29	0.00
28	688531	日联科技	75	10,197.75	0.00
29	301291	明阳电气	321	9,960.63	0.00
30	301303	真兰仪表	434	9,686.88	0.00
31	301399	英特科技	185	9,540.45	0.00
32	301307	美利信	298	9,494.28	0.00
33	688543	国科军工	174	9,230.70	0.00
34	301360	荣旗科技	98	9,074.80	0.00
35	301387	光大同创	198	8,981.28	0.00
36	301383	天键股份	250	8,930.00	0.00
37	688620	安凯微	708	8,736.72	0.00
38	301429	森泰股份	411	8,639.22	0.00
39	688458	美芯晟	94	8,531.44	0.00
40	688146	中船特气	223	8,502.99	0.00
41	301141	中科磁业	198	8,452.62	0.00
42	301246	宏源药业	273	8,383.83	0.00
43	301408	华人健康	494	8,373.30	0.00
44	301210	金杨股份	168	8,260.56	0.00

45	688484	南芯科技	225	8,259.75	0.00
46	301262	海看股份	323	8,236.50	0.00
47	301382	蜂助手	248	8,144.32	0.00
48	301225	恒勃股份	240	7,982.40	0.00
49	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
50	688535	华海诚科	150	7,684.50	0.00
51	300952	恒辉安防	340	7,670.40	0.00
52	688523	航天环宇	318	7,584.30	0.00
53	688352	颀中科技	622	7,507.54	0.00
54	688552	航天南湖	304	7,144.00	0.00
55	688429	时创能源	278	7,097.34	0.00
56	301397	溯联股份	170	6,834.00	0.00
57	603605	珀莱雅	60	6,744.00	0.00
58	688581	安杰思	57	6,727.71	0.00
59	301373	凌玮科技	211	6,720.35	0.00
60	301376	致欧科技	297	6,685.47	0.00
61	300804	广康生化	197	6,495.09	0.00
62	301357	北方长龙	133	6,435.87	0.00
63	688570	天玛智控	254	6,433.82	0.00
64	300971	博亚精工	245	6,431.25	0.00
65	688433	华曙高科	203	6,394.50	0.00
66	301305	朗坤环境	322	6,340.18	0.00
67	301428	世纪恒通	206	6,303.60	0.00
68	301232	飞沃科技	107	6,250.94	0.00
69	301281	科源制药	238	5,973.80	0.00
70	301170	锡南科技	169	5,903.17	0.00
71	301157	华塑科技	111	5,875.23	0.00
72	301322	绿通科技	108	5,749.92	0.00
73	301203	国泰环保	165	5,676.00	0.00
74	301323	新莱福	143	5,628.48	0.00
75	688631	莱斯信息	186	5,555.82	0.00

76	301016	雷尔伟	275	5,516.50	0.00
77	688623	双元科技	60	5,207.40	0.00
78	300763	锦浪科技	50	5,205.00	0.00
79	301337	亚华电子	171	5,193.27	0.00
80	301439	泓淋电力	298	5,036.20	0.00
81	601061	中信金属	654	4,957.32	0.00
82	301033	迈普医学	108	4,747.68	0.00
83	301007	德迈仕	303	4,675.29	0.00
84	603613	国联股份	109	4,025.37	0.00
85	001380	华纬科技	130	4,001.40	0.00
86	603135	中重科技	220	3,935.80	0.00
87	301345	涛涛车业	83	3,871.12	0.00
88	301057	汇隆新材	218	3,758.32	0.00
89	601065	江盐集团	258	3,054.72	0.00
90	601133	柏诚股份	223	2,733.98	0.00
91	001282	三联锻造	81	2,675.43	0.00
92	001328	登康口腔	97	2,472.53	0.00
93	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
94	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
95	001360	南矿集团	134	1,992.58	0.00
96	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
97	603125	常青科技	79	1,937.87	0.00
98	001367	海森药业	47	1,855.56	0.00
99	002603	以岭药业	55	1,412.95	0.00
100	002124	天邦食品	80	363.20	0.00
101	600717	天津港	80	354.40	0.00
102	600064	南京高科	23	152.03	0.00
103	000990	诚志股份	6	45.72	0.00

10 4	600120	浙江东方	10	38.30	0.00
10 5	600522	中天科技	1	15.91	0.00
10 6	600376	首开股份	3	11.70	0.00
10 7	000540	*ST中天	154,400	-	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	901,669.00	0.40
2	000066	中国长城	894,201.00	0.39
3	600372	中航电子	855,498.00	0.38
4	000423	东阿阿胶	782,626.00	0.35
5	000933	神火股份	729,686.00	0.32
6	002240	盛新锂能	723,861.00	0.32
7	603882	金域医学	694,334.00	0.31
8	002008	大族激光	676,910.00	0.30
9	688169	石头科技	611,159.20	0.27
10	300395	菲利华	606,153.00	0.27
11	002600	领益智造	595,455.00	0.26
12	688536	思瑞浦	578,652.00	0.26
13	688220	翱捷科技	568,576.50	0.25
14	601966	玲珑轮胎	531,684.00	0.23
15	300118	东方日升	529,085.00	0.23
16	688072	拓荆科技	527,234.74	0.23
17	300487	蓝晓科技	525,224.00	0.23
18	300595	欧普康视	516,907.00	0.23
19	002432	九安医疗	515,165.77	0.23

20	300438	鹏辉能源	494,813.00	0.22
----	--------	------	------------	------

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	603345	安井食品	1,010,177.00	0.45
2	688122	西部超导	969,424.07	0.43
3	601607	上海医药	928,767.00	0.41
4	603605	珀莱雅	914,572.00	0.40
5	000999	华润三九	890,116.00	0.39
6	002603	以岭药业	833,001.00	0.37
7	601699	潞安环能	764,618.00	0.34
8	603606	东方电缆	764,508.00	0.34
9	603613	国联股份	724,348.00	0.32
10	601872	招商轮船	720,094.00	0.32
11	300168	万达信息	707,884.00	0.31
12	688063	派能科技	698,518.84	0.31
13	600026	中远海能	611,954.00	0.27
14	001286	陕西能源	483,075.00	0.21
15	601333	广深铁路	480,437.00	0.21
16	002212	天融信	458,531.00	0.20
17	600201	生物股份	414,226.00	0.18
18	600728	佳都科技	401,498.00	0.18
19	688343	云天励飞	384,318.00	0.17
20	002396	星网锐捷	368,744.00	0.16

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	57,789,949.97
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	52,869,484.13
--------------	---------------

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元



序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	14,172.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	82,822.67
6	其他应收款	3,930.87
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,926.04

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300308	中际旭创	1,253,325.00	0.52	转融通证券出借
2	688256	寒武纪	507,600.00	0.21	转融通证券出借
3	000988	华工科技	494,130.00	0.21	转融通证券出借
4	300418	昆仑万维	447,108.00	0.19	转融通证券出借
5	600157	永泰能源	419,894.00	0.18	转融通证券出借

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301486	C致尚	96,003.90	0.04	新股未上市
2	301395	仁信新材	95,861.24	0.04	新股未上市

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§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
东财中证500A	9,350	15,961.69	11,151,576.01	7.47%	138,090,212.73	92.53%
东财中证500C	5,104	16,398.57	27,169,580.93	32.46%	56,528,706.53	67.54%
合计	13,773	16,912.81	38,321,156.94	16.45%	194,618,919.26	83.55%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东财中证500A	24,297.42	0.02%
	东财中证500C	54.91	0.00%
	合计	24,352.33	0.01%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	东财中证500A	0~10
	东财中证500C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	东财中证500A	0
	东财中证500C	0
	合计	0

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固 有资金	10,899,819.83	4.68%	10,000,458.38	4.29%	3年
基金管理人高 级管理人员	24,251.45	0.01%	0.00	0.00%	-
基金经理等人 员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股 东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,924,071.28	4.69%	10,000,458.38	4.29%	3年

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

#### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	东财中证500A	东财中证500C
基金合同生效日(2021年01月20 日)基金份额总额	266,643,478.48	138,576,371.83
本报告期期初基金份额总额	161,533,776.86	67,246,214.95
本报告期基金总申购份额	13,245,216.25	30,232,201.15
减：本报告期基金总赎回份额	25,537,204.37	13,780,128.64

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	149,241,788.74	83,698,287.46

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：本报告期基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	单元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
东财证券	2	103,793,535.06	100.00%	108,975.43	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增加注册资本的公告	证监会规定网站及报刊	2023-01-10
2	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2022年第四季度报告	证监会规定网站	2023-01-20
3	西藏东财基金管理有限公司关于更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告	证监会规定网站及报刊	2023-01-31
4	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2022年年度报告	证监会规定网站	2023-03-29
5	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2023年第一季度报告	证监会规定网站	2023-04-21
6	西藏东财基金管理有限公司关于西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金所持停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定网站及报刊	2023-06-27

### §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

西藏东财基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日