
西藏东财中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告

2025 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:2025 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2025年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年01月01日起至2025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	7
§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	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末上市基金前十名持有人	65

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§9 开放式基金份额变动	66
§10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证500ETF基金
场内简称	中证500ETF基金
基金主代码	159337
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年09月02日
基金管理人	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	1,135,710,611.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024年09月20日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。特殊情形包括但不限于：1、法律法规的限制；2、标的指数成份股流动性严重不足；3、标的指数的成份股长期停牌；4、标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；5、标的指数成份股派发现金股息；6、指数

	成份股定期或临时调整；7、标的指数编制方法发生变化；8、其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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 (2025年01月01日- 2025年06月30日)
本期已实现收益	23,550,617.17
本期利润	70,258,422.72
加权平均基金份额本期利润	0.0723
本期加权平均净值利润率	5.69%
本期基金份额净值增长率	4.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)
期末可供分配利润	116,791,598.34
期末可供分配基金份额利润	0.1028
期末基金资产净值	1,494,571,818.14
期末基金份额净值	1.3160
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	31.60%

- 注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.94%	0.78%	4.31%	0.79%	0.63%	-0.01%
过去三个月	1.89%	1.49%	0.98%	1.50%	0.91%	-0.01%
过去六个月	4.30%	1.35%	3.31%	1.36%	0.99%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	31.60%	1.76%	30.10%	1.81%	1.50%	-0.05%

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



注：1、本基金基金合同于2024年9月2日生效。

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

§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2025年6月30日，公司旗下管理49只证券投资基金--西藏东财上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、西藏东财创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证云计算与大数据主题指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证食品饮料指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证新能源指数增强型证券投资基金、西藏东财数字经济优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、西藏东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财稳健配置六个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、西藏东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、西藏东财产业优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财时代优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财成长优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财价值启航混合型发起式证券投资基金、西藏东财产业智选混合型发起式证券投资基金、西藏东财远见成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财景气成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财瑞利债券型证券投资基金、西藏东财中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、西藏东财慧心优选混合型发起式证券投资基金、西藏东财上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、西藏东财卓越成长混合型发起式证券投资基金、西藏东财景气驱动混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财北证50成份指数型发起式证券

投资基金、西藏东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财上证50交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证1-3年国债交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金、西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
吴逸	本基金基金经理	2024-09-02	-	15年	上海财经大学金融数学与金融工程硕士。曾任天治基金管理有限公司产品创新及量化投资部总监助理、西藏东财基金管理有限公司筹备组量化投资负责人、西藏东财基金管理有限公司研究部总监，现任西藏东财基金管理有限公司总经理助理、量化投资部总监、基金经理。
姚楠燕	本基金基金经理助理	2024-09-02	-	8年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。曾任中欧国际工商学院金融学/会计学研究助理、西藏东财基金管理有限公司筹备组成员，现任西藏东财基金管理有限公司基金经理兼基金经理助理。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证500指数，该指数反映沪深市场中小盘市值上市公司证券的整体表现。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年06月30日，中证500ETF基金份额净值为1.3160元，报告期内基金份额净值增长率为4.30%，同期业绩比较基准收益率为3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年中国宏观经济展现韧性，伴随着更加积极有为的宏观政策发力显效，经济运行稳中向好，展现出强大的韧性和活力。数据来看，上半年GDP同比增长5.3%，其中高技术产业增加值同比增长9.5%，新动能在积聚。展望下半年，尽管外部环境仍有不确定性，内部结构调整的压力较大，但综合判断，下半年中国经济保持稳定增长的趋势较为确定。

市场方面，上半年大盘整体呈“N型”走势，震荡上行，A股总市值站上100万亿元，创历史新高，吸引了大量的国内外资金参与。下半年，在弱美元趋势、资本市场政策支持和流动性环境整体改善的推动下，A股市场有望延续震荡上行态势，结构性机会将进一步增多。

行业方面，继续关注围绕科技创新、扩大内需、现金流改善三条线索展开的叙事。

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。

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	22,092,426.25	80,686,335.66
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,487,318,575.48	979,940,145.63
其中：股票投资		1,487,318,575.48	979,940,145.63
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		624,142.70	1,458,147.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,510,035,144.43	1,062,084,628.69
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.60	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		515,026.55	391,116.58
应付托管费		51,502.66	39,111.67
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	14,896,796.48	19,839,264.95
负债合计		15,463,326.29	20,269,493.20
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	1,135,710,611.00	825,710,611.00
未分配利润	6.4.7.8	358,861,207.14	216,104,524.49
净资产合计		1,494,571,818.14	1,041,815,135.49
负债和净资产总计		1,510,035,144.43	1,062,084,628.69

注：报告截止日2025年6月30日，基金份额净值人民币1.3160元，基金份额总额1,135,710,611.00份。

6.2 利润表

会计主体：西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至2025年0 6月30日
一、营业总收入		73,706,955.70
1.利息收入		24,319.23
其中：存款利息收入	6.4.7.9	24,319.23
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,531,436.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	14,254,644.50
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	12,276,792.07
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.16	46,707,805.55

填列)		
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	443,394.35
减：二、营业总支出		3,448,532.98
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,062,899.86
2.托管费	6.4.10.2.2	306,289.96
3.销售服务费		-
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.19	79,343.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,258,422.72
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,258,422.72
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		70,258,422.72

注：本基金基金合同生效日为2024年9月2日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	825,710,611.00	216,104,524.49	1,041,815,135.49
二、本期期初净资产	825,710,611.00	216,104,524.49	1,041,815,135.49

三、本期增减变动 额（减少以“-”号 填列）	310,000,000.00	142,756,682.65	452,756,682.65
（一）、综合收益 总额	-	70,258,422.72	70,258,422.72
（二）、本期基金 份额交易产生的净 资产变动数（净资 产减少以“-”号填 列）	310,000,000.00	72,498,259.93	382,498,259.93
其中：1.基金申购款	464,000,000.00	116,122,854.02	580,122,854.02
2.基金赎回 款	-154,000,000.00	-43,624,594.09	-197,624,594.09
（三）、本期向基 金份额持有人分配 利润产生的净资产 变动（净资产减少 以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资 产	1,135,710,611.00	358,861,207.14	1,494,571,818.14

注：本基金基金合同生效日为2024年9月2日，无上年度可比期间数据。
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交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人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交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的规定，经中国证券

监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1015号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为211,710,611.00份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（24）第00145号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2024年9月2日正式生效。本基金的基金管理人为西藏东财基金管理有限公司，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可少量投资于其他股票（非标的指数成份股或其备选成份股，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。本基金可以根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息

红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

（4）对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券（股票）交易印花税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	1,000,118.70
等于：本金	999,918.35
加：应计利息	200.35
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	21,092,307.55
等于：本金	21,091,335.88
加：应计利息	971.67
减：坏账准备	-

合计	22,092,426.25
----	---------------

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 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,436,197,948.68	-	1,487,318,575.48	51,120,626.80
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		1,436,197,948.68	-	1,487,318,575.48	51,120,626.80

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 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37
可退替代款	-0.60
应退替代款	14,715,266.62
其他应付	102,187.30
合计	14,896,796.48

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	825,710,611.00	825,710,611.00
本期申购	464,000,000.00	464,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-154,000,000.00	-154,000,000.00
本期末	1,135,710,611.00	1,135,710,611.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	64,904,541.28	151,199,983.21	216,104,524.49
本期期初	64,904,541.28	151,199,983.21	216,104,524.49
本期利润	23,550,617.17	46,707,805.55	70,258,422.72
本期基金份额交易产生的变动数	28,336,439.89	44,161,820.04	72,498,259.93
其中：基金申购款	41,519,474.00	74,603,380.02	116,122,854.02
基金赎回款	-13,183,034.11	-30,441,559.98	-43,624,594.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	116,791,598.34	242,069,608.80	358,861,207.14

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	3,651.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	20,667.81
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	24,319.23

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,855,191.65
股票投资收益——赎回差价收入	3,399,452.85
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	14,254,644.50

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	271,090,915.83
减：卖出股票成本总额	259,892,813.53
减：交易费用	342,910.65
买卖股票差价收入	10,855,191.65

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
赎回基金份额对价总额	197,624,594.09
减：现金支付赎回款总额	102,327,320.09
减：赎回股票成本总额	91,897,821.15
减：交易费用	-
赎回差价收入	3,399,452.85

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期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 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	12,276,792.07
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	12,276,792.07

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	46,707,805.55
——股票投资	46,707,805.55
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	46,707,805.55

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
----	-------------------------------

基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	443,394.35
合计	443,394.35

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 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	79,343.16

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
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金托管人
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商

西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金
--------------------------------	--------------

注：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 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
东财证券	804,806,014.90	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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 2025年01月01日至2025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	155,362.51	100.00%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

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

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 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,062,899.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	30,162.78
应支付基金管理人的净管理费	3,032,737.08

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 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	306,289.96

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

6.4.10.3 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

- 1、本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。
- 2、本基金基金合同生效日为2024年9月2日，本期是指2025年1月1日至2025年6月30日，无上年度可比期间数据。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年06月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
东财证券	902,234,747.00	79.44%	502,000,000.00	60.80%
西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	142,296,171.00	12.53%	177,744,571.00	21.53%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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	
	2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中金公司-托管户	1,000,118.70	3,651.42
东财证券-证券资金户	21,092,307.55	20,667.81

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

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025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
6884	海博	2025	6个月	新股	19.3	83.4	560	10,8	46,7	-

11	思创	-01-20		限售	8	9		52.80	54.40	
688545	兴福电子	2025-01-15	6个月	新股限售	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
301458	钧崑电子	2025-01-02	6个月	新股限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
688583	思看科技	2025-01-08	6个月	新股限售	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	其中52股为锁定期送股所得
301678	新恒汇	2025-06-13	6个月	新股限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-15	6个月	新股限售	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6个月	新股限售	39.92	45.22	349	9,620.72	15,781.78	其中108股为锁定期送股所得
301479	弘景光电	2025-03-06	6个月	新股限售	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	其中52股为锁定期送股所得
301535	浙江华远	2025-03-18	6个月	新股限售	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6个月	新股限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
001388	信通电子	2025-06-24	1个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-

688758	赛分科技	2025-01-02	6个月	新股限售	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月	新股限售	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6个月	新股限售	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6个月	新股限售	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6个月	新股限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6个月	新股限售	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6个月	新股限售	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6个月	新股限售	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血净	2025-05-12	6个月	新股限售	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6个月	新股限售	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6个月	新股限售	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6个月	新股限售	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
6032	永杰	2025	6个月	新股	20.6	35.0	126	2,59	4,42	-

71	新材	-03-04		限售	0	8		5.60	0.08	
603124	江南新材	2025-03-12	6个月	新股限售	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6个月	新股限售	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6个月	新股限售	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603400	华之杰	2025-06-12	6个月	新股限售	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6个月	新股限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6个月	新股限售	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6个月	新股限售	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	新股限售	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

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

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

本基金本报告期末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

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

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

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 2025年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,092,426.25	-	-	-	22,092,426.25
交易性金融资产	-	-	-	1,487,318,575.48	1,487,318,575.48
应收清算款	-	-	-	624,142.70	624,142.70
资产总计	22,092,426.25	-	-	1,487,942,718.18	1,510,035,144.43
负债					
应付清算款	-	-	-	0.60	0.60
应付管理人报酬	-	-	-	515,026.55	515,026.55
应付托管费	-	-	-	51,502.66	51,502.66
其他负债	-	-	-	14,896,796.48	14,896,796.48
负债总计	-	-	-	15,463,326.29	15,463,326.29

计					
利率敏感度缺口	22,092,426.25	-	-	1,472,479,391.89	1,494,571,818.14
上年度末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	80,686,335.66	-	-	-	80,686,335.66
交易性金融资产	-	-	-	979,940,145.63	979,940,145.63
应收清算款	-	-	-	1,458,147.40	1,458,147.40
资产总计	80,686,335.66	-	-	981,398,293.03	1,062,084,628.69
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	391,116.58	391,116.58
应付托管费	-	-	-	39,111.67	39,111.67
其他负债	-	-	-	19,839,264.95	19,839,264.95
负债总计	-	-	-	20,269,493.20	20,269,493.20
利率敏感度缺口	80,686,335.66	-	-	961,128,799.83	1,041,815,135.49

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

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 2025年06月30日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,487,318,575.48	99.51	979,940,145.63	94.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产	-	-	-	-
—权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	1,487,318,575.48	99.51	979,940,145.63	94.06

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	73,730,569.04	49,383,994.96
	业绩比较基准下降5%	-73,730,569.04	-49,383,994.96

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	1,486,969,178.86	979,717,247.22
第二层次	15,385.54	27,736.50
第三层次	334,011.08	195,161.91

合计	1,487,318,575.48	979,940,145.63
----	------------------	----------------

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2025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（2024年12月31日：同）。

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	1,487,318,575.48	98.50
	其中：股票	1,487,318,575.48	98.50
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	22,092,426.25	1.46
8	其他各项资产	624,142.70	0.04
9	合计	1,510,035,144.43	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

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	3,763,032.00	0.25
B	采矿业	53,123,233.00	3.55
C	制造业	940,325,136.84	62.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,988,176.00	3.21
E	建筑业	13,143,696.00	0.88
F	批发和零售业	32,691,025.00	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	24,665,828.00	1.65
H	住宿和餐饮业	4,013,499.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	139,446,446.61	9.33
J	金融业	145,913,613.10	9.76
K	房地产业	18,389,578.96	1.23
L	租赁和商务服务业	12,779,903.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	9,877,384.82	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	6,158,988.00	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	3,063,060.00	0.20
Q	卫生和社会工作	6,808,118.76	0.46
R	文化、体育和娱乐业	21,091,315.00	1.41
S	综合	3,498,304.00	0.23
	合计	1,486,740,338.09	99.48

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	559,166.89	0.04
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	2,244.00	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	16,826.50	0.00
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	578,237.39	0.04
--	----	------------	------

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	120,700	16,219,666.00	1.09
2	000988	华工科技	207,000	9,731,070.00	0.65
3	600988	赤峰黄金	337,000	8,384,560.00	0.56
4	300339	润和软件	162,400	8,254,792.00	0.55
5	002966	苏州银行	904,200	7,938,876.00	0.53
6	688521	芯原股份	77,733	7,501,234.50	0.50
7	600839	四川长虹	745,000	7,241,400.00	0.48
8	601555	东吴证券	801,900	7,016,625.00	0.47
9	601162	天风证券	1,403,900	6,921,227.00	0.46
10	689009	九号公司	116,096	6,869,400.32	0.46
11	603893	瑞芯微	44,600	6,772,956.00	0.45
12	688213	思特威	65,964	6,742,840.08	0.45
13	002517	恺英网络	344,600	6,654,226.00	0.45
14	002340	格林美	1,033,700	6,563,995.00	0.44
15	002558	巨人网络	275,300	6,483,315.00	0.43
16	002195	岩山科技	1,146,100	6,452,543.00	0.43
17	002261	拓维信息	206,900	6,403,555.00	0.43
18	002156	通富微电	242,400	6,210,288.00	0.42
19	600487	亨通光电	398,600	6,098,580.00	0.41
20	600157	永泰能源	4,494,000	6,021,960.00	0.40
21	002797	第一创业	849,600	6,015,168.00	0.40

22	300251	光线传媒	294,400	5,967,488.00	0.40
23	300207	欣旺达	296,100	5,939,766.00	0.40
24	000066	中国长城	392,100	5,803,080.00	0.39
25	600096	云天化	262,000	5,756,140.00	0.39
26	688777	中控技术	127,963	5,746,818.33	0.38
27	300803	指南针	69,990	5,645,393.40	0.38
28	002273	水晶光电	281,500	5,621,555.00	0.38
29	601168	西部矿业	337,700	5,615,951.00	0.38
30	688002	睿创微纳	80,141	5,587,430.52	0.37
31	002465	海格通信	400,600	5,584,364.00	0.37
32	600536	中国软件	119,200	5,574,984.00	0.37
33	600879	航天电子	529,800	5,547,006.00	0.37
34	000831	中国稀土	153,400	5,540,808.00	0.37
35	300450	先导智能	222,400	5,526,640.00	0.37
36	601099	太平洋	1,375,100	5,404,143.00	0.36
37	000933	神火股份	321,800	5,354,752.00	0.36
38	688099	晶晨股份	75,404	5,354,438.04	0.36
39	002294	信立泰	112,800	5,338,824.00	0.36
40	300017	网宿科技	496,900	5,326,768.00	0.36
41	600352	浙江龙盛	523,500	5,318,760.00	0.36
42	688578	艾力斯	56,406	5,248,014.24	0.35
43	600885	宏发股份	234,500	5,231,695.00	0.35
44	601108	财通证券	660,800	5,226,928.00	0.35
45	002185	华天科技	516,900	5,220,690.00	0.35
46	688608	恒玄科技	14,269	4,965,326.62	0.33
47	000423	东阿阿胶	94,700	4,952,810.00	0.33
48	601128	常熟银行	672,010	4,952,713.70	0.33
49	688122	西部超导	95,421	4,950,441.48	0.33
50	002281	光迅科技	100,300	4,946,796.00	0.33
51	002130	沃尔核材	207,400	4,940,268.00	0.33
52	688525	佰维存储	73,027	4,922,019.80	0.33

53	300454	深信服	52,100	4,906,778.00	0.33
54	601577	长沙银行	491,400	4,884,516.00	0.33
55	000997	新大陆	149,900	4,853,762.00	0.32
56	600079	人福医药	230,300	4,831,694.00	0.32
57	002738	中矿资源	149,700	4,814,352.00	0.32
58	688469	芯联集成	1,000,897	4,774,278.69	0.32
59	688220	翱捷科技	60,818	4,762,049.40	0.32
60	603596	伯特利	90,200	4,752,638.00	0.32
61	688120	华海清科	28,138	4,746,880.60	0.32
62	688361	中科飞测	56,236	4,734,508.84	0.32
63	002085	万丰奥威	297,700	4,730,453.00	0.32
64	300058	蓝色光标	718,600	4,714,016.00	0.32
65	002850	科达利	41,600	4,707,872.00	0.31
66	002532	天山铝业	564,600	4,691,826.00	0.31
67	300002	神州泰岳	396,700	4,681,060.00	0.31
68	000783	长江证券	672,200	4,658,346.00	0.31
69	300765	新诺威	89,700	4,636,593.00	0.31
70	002851	麦格米特	92,300	4,627,922.00	0.31
71	002138	顺络电子	164,100	4,614,492.00	0.31
72	300458	全志科技	116,200	4,611,978.00	0.31
73	300223	北京君正	66,400	4,594,880.00	0.31
74	600109	国金证券	522,900	4,585,833.00	0.31
75	688235	百济神州	19,537	4,564,624.68	0.31
76	002078	太阳纸业	339,100	4,564,286.00	0.31
77	002595	豪迈科技	77,000	4,559,940.00	0.31
78	300474	景嘉微	62,300	4,547,900.00	0.30
79	002436	兴森科技	341,300	4,518,812.00	0.30
80	002410	广联达	334,900	4,491,009.00	0.30
81	601933	永辉超市	915,600	4,486,440.00	0.30
82	002472	双环传动	133,300	4,464,217.00	0.30
83	600143	金发科技	430,700	4,440,517.00	0.30

84	300054	鼎龙股份	154,700	4,436,796.00	0.30
85	600862	中航高科	169,100	4,410,128.00	0.30
86	601198	东兴证券	392,800	4,379,720.00	0.29
87	002065	东华软件	453,600	4,354,560.00	0.29
88	600580	卧龙电驱	220,160	4,352,563.20	0.29
89	000034	神州数码	114,800	4,321,072.00	0.29
90	600873	梅花生物	402,600	4,303,794.00	0.29
91	002673	西部证券	546,100	4,303,268.00	0.29
92	688617	惠泰医疗	14,480	4,300,560.00	0.29
93	300857	协创数据	49,900	4,294,394.00	0.29
94	300136	信维通信	191,500	4,289,600.00	0.29
95	300346	南大光电	135,500	4,287,220.00	0.29
96	002353	杰瑞股份	122,400	4,284,000.00	0.29
97	002223	鱼跃医疗	120,300	4,282,680.00	0.29
98	300024	机器人	248,900	4,276,102.00	0.29
99	600298	安琪酵母	121,300	4,266,121.00	0.29
100	002202	金风科技	415,100	4,254,775.00	0.28
101	601615	明阳智能	367,400	4,221,426.00	0.28
102	002624	完美世界	275,900	4,185,403.00	0.28
103	300604	长川科技	93,100	4,181,121.00	0.28
104	000021	深科技	221,800	4,156,532.00	0.28
105	000728	国元证券	526,200	4,151,718.00	0.28
106	002008	大族激光	170,100	4,145,337.00	0.28
107	300383	光环新网	289,500	4,139,850.00	0.28
108	600363	联创光电	70,700	4,123,931.00	0.28
109	300496	中科创达	71,500	4,091,230.00	0.27
110	603606	东方电缆	79,100	4,090,261.00	0.27
111	603605	珀莱雅	49,400	4,089,826.00	0.27
112	603659	璞泰来	217,700	4,088,406.00	0.27
113	300395	菲利华	80,000	4,088,000.00	0.27
114	600895	张江高科	158,700	4,078,590.00	0.27

115	300115	长盈精密	188,400	4,031,760.00	0.27
116	603160	汇顶科技	56,100	3,984,783.00	0.27
117	300012	华测检测	340,200	3,976,938.00	0.27
118	002155	湖南黄金	222,020	3,963,057.00	0.27
119	600549	厦门钨业	188,900	3,951,788.00	0.26
120	603129	春风动力	18,100	3,918,650.00	0.26
121	600171	上海贝岭	114,400	3,918,200.00	0.26
122	000426	兴业银锡	247,300	3,907,340.00	0.26
123	300627	华测导航	111,020	3,885,700.00	0.26
124	603087	甘李药业	70,300	3,851,034.00	0.26
125	002444	巨星科技	148,900	3,798,439.00	0.25
126	002821	凯莱英	42,980	3,792,985.00	0.25
127	300037	新宙邦	107,000	3,766,400.00	0.25
128	601216	君正集团	681,900	3,764,088.00	0.25
129	000733	振华科技	74,900	3,748,745.00	0.25
130	688065	凯赛生物	79,439	3,741,576.90	0.25
131	600392	盛和资源	283,500	3,733,695.00	0.25
132	000750	国海证券	904,200	3,725,304.00	0.25
133	688180	君实生物	109,296	3,713,878.08	0.25
134	300003	乐普医疗	268,900	3,705,442.00	0.25
135	300699	光威复材	117,000	3,705,390.00	0.25
136	000519	中兵红箭	169,100	3,701,599.00	0.25
137	601665	齐鲁银行	585,500	3,700,360.00	0.25
138	000932	华菱钢铁	839,900	3,695,560.00	0.25
139	605589	圣泉集团	133,100	3,693,525.00	0.25
140	600060	海信视像	160,200	3,687,804.00	0.25
141	000729	燕京啤酒	284,600	3,679,878.00	0.25
142	601997	贵阳银行	587,300	3,664,752.00	0.25
143	300001	特锐德	152,700	3,660,219.00	0.24
144	688072	拓荆科技	23,750	3,650,612.50	0.24
145	601717	郑煤机	219,600	3,649,752.00	0.24

146	600153	建发股份	349,800	3,627,426.00	0.24
147	601990	南京证券	448,100	3,620,648.00	0.24
148	601696	中银证券	337,400	3,606,806.00	0.24
149	601233	桐昆股份	340,200	3,606,120.00	0.24
149	000878	云南铜业	283,500	3,606,120.00	0.24
151	688385	复旦微电	72,921	3,592,817.67	0.24
152	300142	沃森生物	326,000	3,586,000.00	0.24
153	600699	均胜电子	203,700	3,552,528.00	0.24
154	002414	高德红外	344,500	3,531,125.00	0.24
155	603345	安井食品	43,900	3,530,438.00	0.24
156	688582	芯动联科	52,222	3,509,318.40	0.23
157	600673	东阳光	300,800	3,498,304.00	0.23
158	600369	西南证券	804,000	3,497,400.00	0.23
159	002007	华兰生物	222,500	3,486,575.00	0.23
160	688114	华大智造	53,563	3,472,489.29	0.23
161	002837	英维克	116,800	3,470,128.00	0.23
162	600316	洪都航空	91,200	3,438,240.00	0.23
163	300073	当升科技	77,900	3,417,473.00	0.23
164	600398	海澜之家	489,400	3,406,224.00	0.23
165	600177	雅戈尔	465,100	3,395,230.00	0.23
166	600118	中国卫星	118,500	3,385,545.00	0.23
167	000893	亚钾国际	112,300	3,384,722.00	0.23
168	603979	金诚信	72,600	3,371,544.00	0.23
169	600521	华海药业	180,800	3,368,304.00	0.23
170	600435	北方导航	215,700	3,362,763.00	0.22
171	000738	航发控制	161,200	3,344,900.00	0.22
172	300373	扬杰科技	64,400	3,342,360.00	0.22
173	002152	广电运通	247,100	3,321,024.00	0.22
174	600704	物产中大	628,800	3,313,776.00	0.22
175	600909	华安证券	567,300	3,307,359.00	0.22
176	688249	晶合集成	162,333	3,290,489.91	0.22

177	600497	驰宏锌锗	618,500	3,271,865.00	0.22
178	600141	兴发集团	158,300	3,249,899.00	0.22
179	002958	青农商行	899,800	3,248,278.00	0.22
180	002044	美年健康	631,500	3,245,910.00	0.22
181	002683	广东宏大	95,600	3,244,664.00	0.22
182	000400	许继电气	148,300	3,228,491.00	0.22
183	600562	国睿科技	102,500	3,227,725.00	0.22
184	000623	吉林敖东	189,600	3,213,720.00	0.22
185	300919	中伟股份	97,700	3,212,376.00	0.21
186	300748	金力永磁	134,700	3,211,248.00	0.21
187	000009	中国宝安	361,000	3,205,680.00	0.21
188	600765	中航重机	187,700	3,168,376.00	0.21
189	000528	柳工	328,700	3,158,807.00	0.21
190	002409	雅克科技	57,600	3,150,144.00	0.21
191	603179	新泉股份	67,000	3,146,990.00	0.21
192	002318	久立特材	134,300	3,141,277.00	0.21
193	600155	华创云信	450,300	3,134,088.00	0.21
194	688568	中科星图	86,933	3,130,457.33	0.21
195	000960	锡业股份	204,000	3,121,200.00	0.21
196	600498	烽火通信	147,900	3,110,337.00	0.21
197	688183	生益电子	60,591	3,102,259.20	0.21
198	002841	视源股份	89,100	3,082,860.00	0.21
199	300623	捷捷微电	102,900	3,066,420.00	0.21
200	002607	中公教育	1,001,000	3,063,060.00	0.20
201	300724	捷佳伟创	56,300	3,057,090.00	0.20
202	600038	中直股份	78,700	3,054,347.00	0.20
203	600884	杉杉股份	321,800	3,044,228.00	0.20
204	603228	景旺电子	72,600	3,037,584.00	0.20
205	600637	东方明珠	406,000	3,032,820.00	0.20
206	001696	宗申动力	134,800	3,026,260.00	0.20
207	300558	贝达药业	51,900	3,007,605.00	0.20

208	002739	万达电影	260,500	2,977,515.00	0.20
209	301358	湖南裕能	95,300	2,972,407.00	0.20
210	603939	益丰药房	121,100	2,963,317.00	0.20
211	000039	中集集团	376,300	2,957,718.00	0.20
212	688052	纳芯微	16,941	2,956,035.09	0.20
213	600486	扬农化工	50,500	2,929,000.00	0.20
214	000415	渤海租赁	870,700	2,899,431.00	0.19
215	600529	山东药玻	130,800	2,895,912.00	0.19
216	002926	华西证券	321,900	2,877,786.00	0.19
217	688027	国盾量子	10,432	2,868,904.32	0.19
218	002025	航天电器	55,600	2,858,396.00	0.19
219	300763	锦浪科技	49,800	2,858,022.00	0.19
220	000887	中鼎股份	161,300	2,837,267.00	0.19
221	600901	江苏金租	466,000	2,823,960.00	0.19
222	300285	国瓷材料	162,700	2,822,845.00	0.19
223	688297	中无人机	52,585	2,808,039.00	0.19
224	603486	科沃斯	48,100	2,800,863.00	0.19
225	002385	大北农	692,900	2,799,316.00	0.19
226	002653	海思科	66,100	2,790,742.00	0.19
227	600132	重庆啤酒	50,200	2,766,020.00	0.19
228	002939	长城证券	328,400	2,751,992.00	0.18
229	300144	宋城演艺	321,600	2,749,680.00	0.18
230	002568	百润股份	107,200	2,745,392.00	0.18
231	600863	内蒙华电	663,000	2,724,930.00	0.18
232	600820	隧道股份	446,300	2,722,430.00	0.18
233	600008	首创环保	893,000	2,696,860.00	0.18
234	300679	电连技术	59,400	2,695,572.00	0.18
235	000723	美锦能源	623,200	2,692,224.00	0.18
236	600390	五矿资本	454,400	2,649,152.00	0.18
237	002064	华峰化学	400,500	2,647,305.00	0.18
238	600516	方大炭素	569,200	2,641,088.00	0.18

239	002312	川发龙蟒	228,800	2,626,624.00	0.18
240	300487	蓝晓科技	52,200	2,625,660.00	0.18
241	000703	恒逸石化	446,100	2,623,068.00	0.18
242	600998	九州通	509,700	2,619,858.00	0.18
243	688538	和辉光电	1,118,607	2,617,540.38	0.18
244	600166	福田汽车	960,800	2,603,768.00	0.17
245	603816	顾家家居	101,900	2,600,488.00	0.17
246	688188	柏楚电子	19,588	2,578,956.08	0.17
247	002080	中材科技	132,100	2,575,950.00	0.17
248	600170	上海建工	1,077,600	2,575,464.00	0.17
249	300676	华大基因	51,700	2,573,109.00	0.17
250	600763	通策医疗	62,192	2,567,285.76	0.17
251	300757	罗博特科	17,100	2,564,487.00	0.17
252	300567	精测电子	42,300	2,563,803.00	0.17
253	002500	山西证券	438,300	2,559,672.00	0.17
254	603568	伟明环保	133,900	2,554,812.00	0.17
255	600312	平高电气	165,500	2,547,045.00	0.17
256	605358	立昂微	109,300	2,546,690.00	0.17
257	000513	丽珠集团	70,600	2,544,424.00	0.17
258	600208	衢州发展	858,400	2,540,864.00	0.17
259	002262	恩华药业	121,700	2,528,926.00	0.17
260	601179	中国西电	411,600	2,527,224.00	0.17
261	000683	博源化工	523,600	2,508,044.00	0.17
262	600021	上海电力	284,500	2,500,755.00	0.17
263	600563	法拉电子	22,900	2,498,161.00	0.17
264	000921	海信家电	96,800	2,487,760.00	0.17
265	600985	淮北矿业	219,200	2,485,728.00	0.17
266	002203	海亮股份	239,900	2,475,768.00	0.17
267	600126	杭钢股份	274,700	2,472,300.00	0.17
268	601155	新城控股	180,700	2,471,976.00	0.17
269	603338	浙江鼎力	52,100	2,469,540.00	0.17

270	600380	健康元	222,700	2,456,381.00	0.16
271	601000	唐山港	602,900	2,447,774.00	0.16
272	600583	海油工程	447,900	2,445,534.00	0.16
273	603589	口子窖	70,200	2,442,960.00	0.16
274	000591	太阳能	556,400	2,442,596.00	0.16
275	688728	格科微	157,869	2,431,182.60	0.16
276	603379	三美股份	50,500	2,430,060.00	0.16
277	000629	钒钛股份	943,300	2,414,848.00	0.16
278	002244	滨江集团	247,600	2,414,100.00	0.16
279	600535	天士力	154,100	2,411,665.00	0.16
280	000060	中金岭南	525,900	2,408,622.00	0.16
281	002439	启明星辰	150,600	2,408,094.00	0.16
282	600348	华阳股份	360,700	2,402,262.00	0.16
283	000062	深圳华强	89,400	2,401,284.00	0.16
284	002603	以岭药业	169,100	2,384,310.00	0.16
285	002432	九安医疗	65,400	2,382,522.00	0.16
286	603885	吉祥航空	176,600	2,378,802.00	0.16
287	000830	鲁西化工	230,900	2,378,270.00	0.16
288	000403	派林生物	131,100	2,376,843.00	0.16
289	601991	大唐发电	749,400	2,375,598.00	0.16
290	600872	中炬高新	124,000	2,356,000.00	0.16
291	300146	汤臣倍健	209,600	2,355,904.00	0.16
292	600816	建元信托	795,600	2,347,020.00	0.16
293	002056	横店东磁	165,300	2,338,995.00	0.16
294	688017	绿的谐波	18,666	2,331,196.74	0.16
295	002984	森麒麟	123,600	2,317,500.00	0.16
296	600970	中材国际	269,500	2,312,310.00	0.15
297	600095	湘财股份	230,500	2,311,915.00	0.15
298	300751	迈为股份	32,800	2,281,568.00	0.15
299	601880	辽港股份	1,518,200	2,277,300.00	0.15
300	301536	星宸科技	37,700	2,273,310.00	0.15

301	601016	节能风电	786,500	2,272,985.00	0.15
302	600499	科达制造	231,700	2,270,660.00	0.15
303	603000	人民网	112,000	2,263,520.00	0.15
304	000636	风华高科	164,700	2,262,978.00	0.15
305	603927	中科软	116,900	2,260,846.00	0.15
306	300212	易华录	103,700	2,256,512.00	0.15
307	300677	英科医疗	95,000	2,249,600.00	0.15
308	000958	电投产融	328,700	2,248,308.00	0.15
309	002423	中粮资本	183,700	2,246,651.00	0.15
310	603298	杭叉集团	107,100	2,243,745.00	0.15
311	600859	王府井	160,800	2,233,512.00	0.15
312	300390	天华新能	116,900	2,229,283.00	0.15
313	601966	玲珑轮胎	151,500	2,222,505.00	0.15
314	601456	国联民生	214,200	2,216,970.00	0.15
315	000563	陕国投 A	620,800	2,216,256.00	0.15
316	601611	中国核建	241,000	2,214,790.00	0.15
317	601666	平煤股份	297,500	2,204,475.00	0.15
318	000155	川能动力	224,400	2,203,608.00	0.15
319	688561	奇安信	64,738	2,199,797.24	0.15
320	603156	养元饮品	103,700	2,194,292.00	0.15
321	600655	豫园股份	394,300	2,188,365.00	0.15
322	603077	和邦生物	1,249,200	2,186,100.00	0.15
323	603737	三棵树	59,140	2,179,309.00	0.15
324	600325	华发股份	446,400	2,173,968.00	0.15
325	688676	金盘科技	64,874	2,170,035.30	0.15
326	600483	福能股份	225,100	2,169,964.00	0.15
327	600004	白云机场	237,200	2,158,520.00	0.14
328	603728	鸣志电器	37,500	2,155,125.00	0.14
329	000598	兴蓉环境	298,700	2,153,627.00	0.14
330	600754	锦江酒店	95,800	2,149,752.00	0.14
331	300529	健帆生物	99,500	2,146,215.00	0.14

332	600685	中船防务	78,800	2,142,572.00	0.14
333	600598	北大荒	148,000	2,134,160.00	0.14
334	600511	国药股份	73,100	2,131,596.00	0.14
335	600131	国网信通	120,100	2,125,770.00	0.14
336	002507	涪陵榨菜	164,400	2,102,676.00	0.14
337	003031	中瓷电子	39,500	2,101,795.00	0.14
338	600282	南钢股份	500,400	2,101,680.00	0.14
339	600663	陆家嘴	236,736	2,097,480.96	0.14
340	601958	金钼股份	191,600	2,096,104.00	0.14
341	000050	深天马 A	244,900	2,086,548.00	0.14
342	600271	航天信息	225,100	2,079,924.00	0.14
343	603899	晨光股份	71,600	2,075,684.00	0.14
344	002773	康弘药业	71,600	2,074,252.00	0.14
345	000951	中国重汽	117,900	2,072,682.00	0.14
346	601001	晋控煤业	169,300	2,068,846.00	0.14
347	000987	越秀资本	300,900	2,064,174.00	0.14
348	000559	万向钱潮	269,700	2,063,205.00	0.14
349	600737	中粮糖业	217,900	2,059,155.00	0.14
350	601918	新集能源	318,400	2,056,864.00	0.14
351	002756	永兴材料	64,000	2,032,000.00	0.14
352	600378	昊华科技	74,800	2,024,836.00	0.14
353	600739	辽宁成大	183,000	2,013,000.00	0.13
354	600582	天地科技	335,500	2,009,645.00	0.13
355	300601	康泰生物	131,900	2,003,561.00	0.13
356	002429	兆驰股份	456,900	2,001,222.00	0.13
357	300888	稳健医疗	48,600	1,997,460.00	0.13
358	688278	特宝生物	27,631	1,992,471.41	0.13
359	300070	碧水源	441,800	1,988,100.00	0.13
360	300573	兴齐眼药	38,260	1,981,485.40	0.13
361	601333	广深铁路	684,700	1,978,783.00	0.13
362	002430	杭氧股份	101,700	1,975,014.00	0.13

363	603341	龙旗科技	48,600	1,974,618.00	0.13
364	688772	珠海冠宇	137,410	1,963,588.90	0.13
365	601866	中远海发	794,500	1,962,415.00	0.13
366	601098	中南传媒	149,200	1,957,504.00	0.13
367	002120	韵达股份	291,500	1,953,050.00	0.13
368	600764	中国海防	57,300	1,948,200.00	0.13
369	603688	石英股份	55,100	1,940,622.00	0.13
370	600867	通化东宝	235,800	1,933,560.00	0.13
371	000032	深桑达 A	95,400	1,929,942.00	0.13
372	600329	达仁堂	57,500	1,918,200.00	0.13
373	601231	环旭电子	130,000	1,901,900.00	0.13
374	600566	济川药业	71,700	1,887,861.00	0.13
375	601212	白银有色	602,700	1,886,451.00	0.13
376	002508	老板电器	98,400	1,870,584.00	0.13
377	600707	彩虹股份	289,100	1,867,586.00	0.12
378	600258	首旅酒店	131,900	1,863,747.00	0.12
379	301308	江波龙	21,300	1,863,537.00	0.12
380	300735	光弘科技	74,200	1,862,420.00	0.12
381	600995	南网储能	190,000	1,858,200.00	0.12
382	000027	深圳能源	287,700	1,835,526.00	0.12
383	603529	爱玛科技	53,000	1,823,200.00	0.12
384	603858	步长制药	112,000	1,818,880.00	0.12
385	600578	京能电力	404,500	1,816,205.00	0.12
386	600906	财达证券	265,800	1,812,756.00	0.12
387	000967	盈峰环境	260,500	1,810,475.00	0.12
388	688520	神州细胞	30,248	1,810,342.80	0.12
389	000709	河钢股份	838,100	1,810,296.00	0.12
390	688301	奕瑞科技	20,406	1,787,769.66	0.12
391	600546	山煤国际	204,600	1,786,158.00	0.12
392	000883	湖北能源	394,600	1,779,646.00	0.12
393	002299	圣农发展	123,700	1,767,673.00	0.12

394	600517	国网英大	345,700	1,763,070.00	0.12
395	002670	国盛金控	116,700	1,756,335.00	0.12
396	601928	凤凰传媒	156,900	1,752,573.00	0.12
397	601399	国机重装	580,600	1,741,800.00	0.12
398	600959	江苏有线	506,200	1,741,328.00	0.12
399	600848	上海临港	189,800	1,721,486.00	0.12
400	688234	天岳先进	29,187	1,708,898.85	0.11
401	002831	裕同科技	72,300	1,693,266.00	0.11
402	600808	马钢股份	488,400	1,684,980.00	0.11
403	688363	华熙生物	32,716	1,679,966.60	0.11
404	300957	贝泰妮	37,900	1,675,938.00	0.11
405	300595	欧普康视	109,400	1,670,538.00	0.11
406	603225	新凤鸣	156,700	1,668,855.00	0.11
407	600968	海油发展	408,700	1,667,496.00	0.11
408	600528	中铁工业	224,900	1,659,762.00	0.11
409	000825	太钢不锈	460,200	1,652,118.00	0.11
410	600977	中国电影	154,000	1,650,880.00	0.11
411	603290	斯达半导	20,300	1,649,781.00	0.11
412	601156	东航物流	126,000	1,649,340.00	0.11
413	000739	普洛药业	117,400	1,643,600.00	0.11
414	601636	旗滨集团	327,800	1,642,278.00	0.11
415	601608	中信重工	374,500	1,636,565.00	0.11
416	002572	索菲亚	116,300	1,629,363.00	0.11
417	601118	海南橡胶	345,100	1,628,872.00	0.11
418	603565	中谷物流	169,800	1,621,590.00	0.11
419	002266	浙富控股	524,700	1,616,076.00	0.11
420	600871	石化油服	825,800	1,610,310.00	0.11
421	603650	彤程新材	49,800	1,601,070.00	0.11
422	000543	皖能电力	228,700	1,600,900.00	0.11
423	688778	厦钨新能	28,580	1,598,193.60	0.11
424	600056	中国医药	154,200	1,594,428.00	0.11

425	601598	中国外运	322,200	1,588,446.00	0.11
426	301301	川宁生物	131,700	1,585,668.00	0.11
427	600801	华新水泥	132,300	1,566,432.00	0.10
428	688387	信科移动	276,640	1,563,016.00	0.10
429	601106	中国一重	556,500	1,558,200.00	0.10
430	603233	大参林	95,500	1,556,650.00	0.10
431	000785	居然智家	504,600	1,539,030.00	0.10
432	000582	北部湾港	185,200	1,527,900.00	0.10
433	688318	财富趋势	13,037	1,498,212.04	0.10
434	688349	三一重能	59,850	1,492,659.00	0.10
435	301498	乖宝宠物	13,600	1,487,432.00	0.10
436	600062	华润双鹤	79,600	1,485,336.00	0.10
437	600925	苏能股份	279,300	1,460,739.00	0.10
438	002153	石基信息	166,200	1,439,292.00	0.10
439	603658	安图生物	38,200	1,432,500.00	0.10
440	000429	粤高速 A	106,900	1,424,977.00	0.10
441	600373	中文传媒	136,800	1,404,936.00	0.09
442	000537	中绿电	167,600	1,401,136.00	0.09
443	600606	绿地控股	852,000	1,388,760.00	0.09
444	601965	中国汽研	77,200	1,370,300.00	0.09
445	601568	北元集团	324,200	1,345,430.00	0.09
446	001286	陕西能源	154,600	1,345,020.00	0.09
447	600098	广州发展	214,900	1,343,125.00	0.09
448	600361	创新新材	333,400	1,330,266.00	0.09
449	688425	铁建重工	323,447	1,319,663.76	0.09
450	002372	伟星新材	126,300	1,308,468.00	0.09
451	688563	航材股份	22,924	1,298,186.12	0.09
452	688702	盛科通信	20,886	1,275,716.88	0.09
453	600688	上海石化	445,900	1,270,815.00	0.09
454	000937	冀中能源	216,300	1,243,725.00	0.08
455	003022	联泓新科	77,100	1,220,493.00	0.08

456	601019	山东出版	124,400	1,178,068.00	0.08
457	688172	燕东微	59,051	1,160,942.66	0.08
458	002608	江苏国信	155,500	1,139,815.00	0.08
459	600032	浙江新能	149,700	1,131,732.00	0.08
460	000898	鞍钢股份	487,000	1,129,840.00	0.08
461	688281	华秦科技	18,513	1,120,221.63	0.07
462	603707	健友股份	100,400	1,119,460.00	0.07
463	600339	中油工程	338,800	1,107,876.00	0.07
464	601139	深圳燃气	173,700	1,104,732.00	0.07
465	000959	首钢股份	318,400	1,082,560.00	0.07
466	603556	海兴电力	42,100	1,072,287.00	0.07
467	600612	老凤祥	21,500	1,069,625.00	0.07
468	600928	西安银行	271,800	1,065,456.00	0.07
469	002461	珠江啤酒	93,300	1,053,357.00	0.07
470	003035	南网能源	229,200	1,052,028.00	0.07
471	600720	中交设计	135,000	1,043,550.00	0.07
472	600295	鄂尔多斯	118,800	1,034,748.00	0.07
473	301267	华夏眼科	51,900	994,923.00	0.07
474	301165	锐捷网络	16,180	994,422.80	0.07
475	601228	广州港	301,500	973,845.00	0.07
476	688100	威胜信息	25,047	927,991.35	0.06
477	688248	南网科技	28,767	905,009.82	0.06
478	600007	中国国贸	43,300	891,114.00	0.06
479	601061	中信金属	109,700	867,727.00	0.06
480	600927	永安期货	58,500	866,385.00	0.06
481	002563	森马服饰	164,400	864,744.00	0.06
482	688475	萤石网络	26,744	842,970.88	0.06
483	688032	禾迈股份	8,399	838,724.14	0.06
484	603826	坤彩科技	42,500	831,725.00	0.06
485	000539	粤电力 A	178,400	809,936.00	0.05
486	002945	华林证券	54,900	788,913.00	0.05

487	688375	国博电子	13,106	786,491.06	0.05
488	300140	节能环保	123,400	761,378.00	0.05
489	603786	科博达	13,700	759,117.00	0.05
490	601921	浙版传媒	93,600	754,416.00	0.05
491	600299	安迪苏	77,400	746,910.00	0.05
492	001213	中铁特货	178,100	723,086.00	0.05
493	601858	中国科传	35,900	698,255.00	0.05
494	688819	天能股份	23,109	641,505.84	0.04
495	601158	重庆水务	115,900	537,776.00	0.04
496	600956	新天绿能	61,300	473,236.00	0.03
497	688153	唯捷创芯	14,590	452,435.90	0.03
498	001389	广合科技	6,500	382,005.00	0.03
499	688295	中复神鹰	16,811	349,668.80	0.02
500	603868	飞科电器	8,100	290,547.00	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	301662	宏工科技	1,429	147,882.02	0.01
2	001356	富岭股份	7,084	102,994.21	0.01
3	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
4	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
5	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
6	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
7	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
8	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
9	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
10	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
11	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00

12	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
13	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
14	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
15	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
16	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
17	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
18	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
19	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
20	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
21	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
22	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
23	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
24	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
25	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
26	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
27	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
28	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
29	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
30	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
31	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	688608	恒玄科技	5,351,504.93	0.51
2	688235	百济神州	5,219,275.06	0.50
3	000933	神火股份	4,636,224.00	0.45
4	600363	联创光电	4,325,282.82	0.42

5	688213	思特威	4,292,529.18	0.41
6	300450	先导智能	4,223,053.00	0.41
7	300454	深信服	4,019,207.00	0.39
8	688578	艾力斯	3,902,159.73	0.37
9	002130	沃尔核材	3,877,746.00	0.37
10	603659	璞泰来	3,849,799.00	0.37
11	300458	全志科技	3,839,807.00	0.37
12	600171	上海贝岭	3,835,366.00	0.37
13	688220	翱捷科技	3,826,853.29	0.37
14	605589	圣泉集团	3,713,050.00	0.36
15	300346	南大光电	3,643,473.40	0.35
16	002851	麦格米特	3,604,309.00	0.35
17	688582	芯动联科	3,586,319.17	0.34
18	688521	芯原股份	3,557,433.08	0.34
19	300857	协创数据	3,516,052.00	0.34
20	688525	佰维存储	3,421,042.39	0.33

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	600418	江淮汽车	14,552,995.00	1.40
2	002625	光启技术	10,151,657.00	0.97
3	002384	东山精密	7,648,292.50	0.73
4	301236	软通动力	5,261,133.00	0.50
5	300866	安克创新	4,555,443.00	0.44
6	302132	中航成飞	4,129,857.00	0.40
7	002128	电投能源	3,814,567.00	0.37
8	601567	三星医疗	3,489,589.00	0.33

9	688047	龙芯中科	3,463,045.51	0.33
10	600642	申能股份	3,384,523.00	0.32
11	688213	思特威	2,624,497.39	0.25
12	688005	容百科技	2,484,555.74	0.24
13	002407	多氟多	2,448,583.20	0.24
14	688578	艾力斯	2,436,476.69	0.23
15	688220	翱捷科技	2,371,346.02	0.23
16	688536	思瑞浦	2,347,846.94	0.23
17	603444	吉比特	2,195,000.00	0.21
18	688331	荣昌生物	2,161,854.10	0.21
19	000818	航锦科技	2,100,392.00	0.20
20	600416	湘电股份	2,087,793.00	0.20

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	534,981,200.58
卖出股票收入（成交）总额	271,090,915.83

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

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

苏州银行：2025年4月9日，中国证券监督管理委员会江苏监管局对苏州银行股份有限公司采取出具警示函的监管措施。2024年7月31日，国家金融监督管理总局江苏监管局对苏州银行股份有限公司处以行政处罚。

东吴证券：2025年1月2日，中国证券监督管理委员会对东吴证券股份有限公司处以行政处罚。

本基金为指数型基金，采取完全复制策略，跟踪的标的指数为中证500指数，以上股票为指数成份股。以上股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除此以外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	624,142.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	624,142.70

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	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股限售
2	688545	兴福电子	26,788.30	0.00	新股限售
3	301458	钧崴电子	23,911.11	0.00	新股限售
4	301662	宏工科技	11,797.50	0.00	新股限售
5	001356	富岭股份	10,237.96	0.00	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

持有人 户数	户均持有的基 金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	西藏东财中证5 00交易型开放

(户)						式指数证券投资 基金发起式 联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占 总 份 额 比 例
4,426	256,599.78	1,047,703,673.00	92.25%	88,006,938.00	7.75%	142,296,171.00	12.53%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份 额比例
1	东方财富证券股份有限公司	902,234,747.00	79.44%
2	於之华	2,815,000.00	0.25%
3	刘曙峰	2,188,800.00	0.19%
4	李明	1,457,600.00	0.13%
5	众牙联数字科技（都昌）有限公司	1,041,500.00	0.09%
6	李健	991,700.00	0.09%
7	范存英	983,300.00	0.09%
8	欧丽君	916,200.00	0.08%
9	博瑞私募基金管理（海南）有限公司－博瑞佳启私募证券投资基金	846,700.00	0.07%
10	李杰	800,000.00	0.07%
11	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	142,296,171.00	12.53%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2024年09月02日)基金份额总额	211,710,611.00
本报告期期初基金份额总额	825,710,611.00
本报告期基金总申购份额	464,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	154,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,135,710,611.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：自2025年3月26日起，顾勇先生担任西藏东财基金管理有限公司副总经理。

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，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
东财证券	6	804,806,014.90	100.00%	155,362.51	100.00%	-

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况等因素的基础上，选择证券经纪商。
- 3、选择券商的程序：
- （1）本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；
- （2）本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东财证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年第4季度报告	证监会规定网站	2025-01-22
2	西藏东财基金管理有限公司关于更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告	证监会规定网站及报刊	2025-01-25
3	西藏东财基金管理有限公司高级管理人员任职公告	证监会规定网站及报刊	2025-03-26
4	西藏东财基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）	证监会规定网站及报刊	2025-03-28
5	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金2024年年度报告	证监会规定网站	2025-03-28
6	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金2025年第1季度报告	证监会规定网站	2025-04-22
7	西藏东财基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	证监会规定网站及报刊	2025-06-06
8	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2025-06-28
9	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金基金	证监会规定网站	2025-06-28

	产品资料概要更新		
--	----------	--	--

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025-01-01至2025-06-30	502,000,000.00	582,269,769.00	182,035,022.00	902,234,747.00	79.44%
ETF联接基金	1	2025-01-01至2025-01-02	177,744,571.00	4,180,300.00	39,628,700.00	142,296,171.00	12.53%
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险。							

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交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- 二、《西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 三、《西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

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
二〇二五年八月二十九日