
西藏东财中证 A500 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:国信证券股份有限公司

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。

基金托管人国信证券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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	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	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	67
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	67
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末上市基金前十名持有人	70

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息	73
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	74
12.3 查阅方式	74

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	A500ETF东财
场内简称	A500ETF东财
基金主代码	159380
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年12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	国信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	862,804,337.00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	2025年01月08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A500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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	沙福贵	薛璐
	联系电话	021-23526999	0755-22940163
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		400-9210-107	0755-61897778
传真		021-23526940	0755-22940165
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼2层01室	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码		200030	518000
法定代表人		戴彦	张纳沙

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	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

点	
---	--

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	22,338,685.94
本期利润	39,566,341.13
加权平均基金份额本期利润	0.0829
本期加权平均净值利润率	8.07%
本期基金份额净值增长率	6.06%
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	38,256,224.43
期末可供分配基金份额利润	0.0443
期末基金资产净值	914,264,494.44
期末基金份额净值	1.0596
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	5.96%

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。

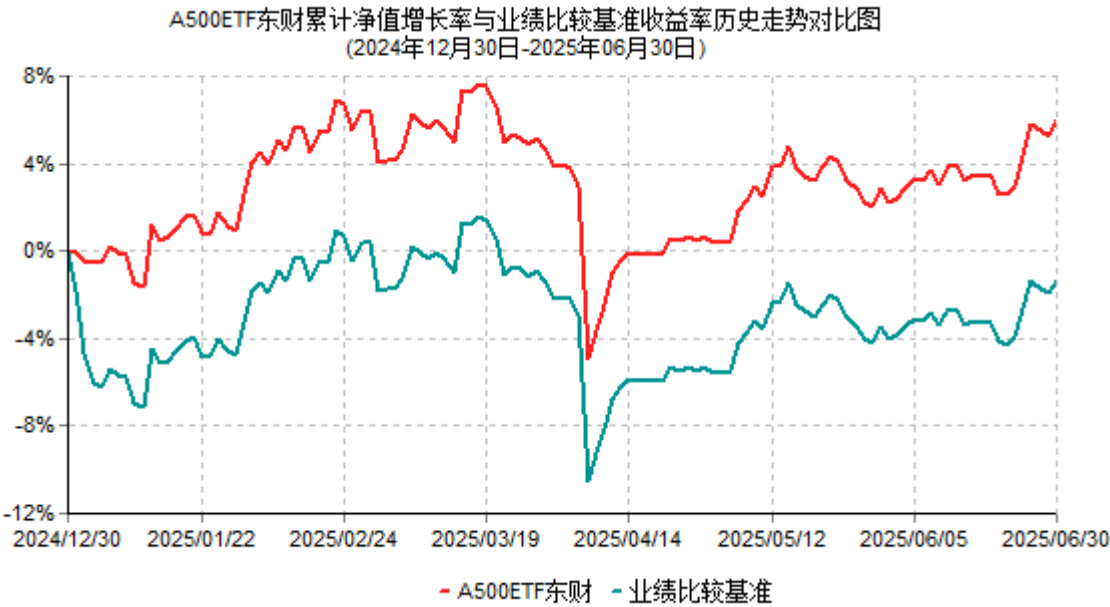
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	3.64%	0.59%	2.82%	0.60%	0.82%	-0.01%
过去三个月	2.05%	1.19%	0.84%	1.20%	1.21%	-0.01%
过去六个月	6.06%	1.05%	0.47%	1.10%	5.59%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	5.96%	1.04%	-1.34%	1.11%	7.30%	-0.07%

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12月30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	2024-12-30	-	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	2024-12-30	-	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A500指数，该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的500只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性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，A500ETF东财份额净值为1.0596元，报告期内基金份额净值增长率为6.06%，同期业绩比较基准收益率为0.47%。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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A500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	34,173,017.35	642,761,572.66
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	906,126,050.91	78,328,373.44

其中：股票投资		906,126,050.91	78,328,373.44
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		1,849,683.96	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	41,936.32
资产总计		942,148,752.22	721,131,882.42
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		65,424.42	2,958.32
应付托管费		21,808.14	986.11
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	27,797,025.22	-
负债合计		27,884,257.78	3,944.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	862,804,337.00	721,804,337.00
未分配利润	6.4.7.8	51,460,157.44	-676,399.01
净资产合计		914,264,494.44	721,127,937.99
负债和净资产总计		942,148,752.22	721,131,882.42

注：报告截止日2025年6月30日，基金份额净值人民币1.0596元，基金份额总额862,804,337.00份。

6.2 利润表

会计主体：西藏东财中证A500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		40,139,413.99
1.利息收入		81,751.73
其中：存款利息收入	6.4.7.9	81,751.73
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）		21,401,340.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	15,210,583.41
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	6,190,756.87
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	17,227,655.19
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	1,428,666.79
减：二、营业总支出		573,072.86
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	370,297.27
2.托管费	6.4.10.2.2	123,432.43
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）		39,566,341.13
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,566,341.13
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		39,566,341.13

注：本基金基金合同生效日为2024年12月30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A500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	721,804,337.00	-676,399.01	721,127,937.99
二、本期期初净资产	721,804,337.00	-676,399.01	721,127,937.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	141,000,000.00	52,136,556.45	193,136,556.45
（一）、综合收益总额	-	39,566,341.13	39,566,341.13
（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）	141,000,000.00	12,570,215.32	153,570,215.32
其中：1.基金申购款	843,000,000.00	28,686,611.61	871,686,611.61
2.基金赎回款	-702,000,000.00	-16,116,396.29	-718,116,396.29
（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	862,804,337.00	51,460,157.44	914,264,494.44

注：本基金基金合同生效日为2024年12月30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A500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A500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A500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]1753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721,804,337.00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00252号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2024年12月30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，基金托管人为国信证券股份有限公司。

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、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、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：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A500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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2025年1月1日至2025年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和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的，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。申购及赎回等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

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净资产的比例，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。

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

（3）公允价值变动收益

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

（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和托管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（实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配采取现金分红方式；

（3）每一基金份额享有同等分配权；

（4）本基金以使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

（5）基金管理人每月可对基金累计报酬率和标的指数同期累计报酬率进行评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率时，可进行收益分配；

（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后，可在不违反法律法规规定的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

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) 根据中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务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	1,000,255.00
等于：本金	999,935.13
加：应计利息	319.87
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	33,172,762.35
等于：本金	33,171,234.64
加：应计利息	1,527.71
减：坏账准备	-
合计	34,173,017.35

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	889,584,747.16	-	906,126,050.91	16,541,303.75
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		889,584,747.16	-	906,126,050.91	16,541,303.75

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	186.30
应退替代款	27,692,310.67
其他应付	25,185.09
合计	27,797,025.22

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	721,804,337.00	721,804,337.00
本期申购	843,000,000.00	843,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-702,000,000.00	-702,000,000.00
本期末	862,804,337.00	862,804,337.00

注：本基金基金合同于2024年12月30日生效，基金合同生效日的基金份额总额为721,804,337.00份基金份额，其中认购资金利息折合42,337.00份基金份额。

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	9,952.43	-686,351.44	-676,399.01
本期期初	9,952.43	-686,351.44	-676,399.01
本期利润	22,338,685.94	17,227,655.19	39,566,341.13
本期基金份额交易产生的变动数	15,907,586.06	-3,337,370.74	12,570,215.32
其中：基金申购款	23,159,168.59	5,527,443.02	28,686,611.61
基金赎回款	-7,251,582.53	-8,864,813.76	-16,116,396.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,256,224.43	13,203,933.01	51,460,157.44

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	4,665.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	77,086.43
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	81,751.73

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	8,178,037.42
股票投资收益——赎回差价收入	7,032,545.99
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	15,210,583.41

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	526,428,776.82
减：卖出股票成本总额	517,524,215.21
减：交易费用	726,524.19
买卖股票差价收入	8,178,037.42

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	718,116,396.29
减：现金支付赎回款总额	410,705,254.29
减：赎回股票成本总额	300,378,596.01
减：交易费用	-
赎回差价收入	7,032,545.99

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 资产支持证券投资基金收益

本基金本报告期无资产支持证券投资基金收益。

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	6,190,756.87
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	6,190,756.87

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	17,227,655.19
——股票投资	17,227,655.19
——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	17,227,655.19

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	1,428,666.79
合计	1,428,666.79

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
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金托管人、基金销售机构
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	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A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	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	1,796,579,815.20	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	348,124.53	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	370,297.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,997.78
应支付基金管理人的净管理费	361,299.49

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%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：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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 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	123,432.43

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

本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期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

- 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12月30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	750,186,236.00	86.95%	100,004,861.00	13.85%
西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	80,994,500.00	9.39%	0.00	0.00%

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
国信证券-托管户	1,000,255.00	4,665.30
东财证券-证券资金户	33,172,762.35	77,086.43

注：1、本基金的银行存款存放在托管人国信证券在交通银行股份有限公司开立的托管账户中，本基金本报告期内无源自本基金托管人国信证券的银行存款及利息收入。

2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于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

本基金本报告期末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

于本报告期末，本基金因指数成份股原因被动持有基金管理人的重大利害关系人东方财富信息股份有限公司发行的证券（300059）391,700股，市值为人民币9,060,021.00元，占本基金资产净值的比例为0.99%。（于上年度末：持有43,900股，市值为人民币1,133,498.00元，占本基金资产净值的比例为0.16%。）

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

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
688775	影石创新	2025-06-04	6个月	新股限售	47.27	124.16	353	16,686.31	43,828.48	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6个月	新股限售	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
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	-
3015	恒鑫	2025	6个月	新股	39.9	45.2	349	9,62	15,7	其中10

01	生活	-03-11		限售	2	2		0.72	81.78	8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
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	-
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	-
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	-
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	-
6032	泰鸿	2025	6个月	新股	8.60	15.6	286	2,45	4,46	-

10	万立	-04-01		限售		1		9.60	4.46	
603271	永杰新材	2025-03-04	6个月	新股限售	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
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況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	34,173,017.35	-	-	-	34,173,017.35
交易性 金融资 产	-	-	-	906,126,050.91	906,126,050.91
应收清 算款	-	-	-	1,849,683.96	1,849,683.96
资产总 计	34,173,017.35	-	-	907,975,734.87	942,148,752.22
负债					
应付管 理人报 酬	-	-	-	65,424.42	65,424.42
应付托 管费	-	-	-	21,808.14	21,808.14
其他负 债	-	-	-	27,797,025.22	27,797,025.22

负债总计	-	-	-	27,884,257.78	27,884,257.78
利率敏感度缺口	34,173,017.35	-	-	880,091,477.09	914,264,494.44
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	642,761,572.66	-	-	-	642,761,572.66
交易性金融资产	-	-	-	78,328,373.44	78,328,373.44
其他资产	-	-	-	41,936.32	41,936.32
资产总计	642,761,572.66	-	-	78,370,309.76	721,131,882.42
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,958.32	2,958.32
应付托管费	-	-	-	986.11	986.11
负债总计	-	-	-	3,944.43	3,944.43
利率敏感度缺口	642,761,572.66	-	-	78,366,365.33	721,127,937.99

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	906,126,050.91	99.11	78,328,373.44	10.86
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	-	-	-	-

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	906,126,050.91	99.11	78,328,373.44	10.86

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%	41,946,185.77	903,409.39
	业绩比较基准下降5%	-41,946,185.77	-903,409.39

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	905,899,827.50	78,328,373.44
第二层次	15,385.54	-
第三层次	210,837.87	-
合计	906,126,050.91	78,328,373.44

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	906,126,050.91	96.18
	其中：股票	906,126,050.91	96.18
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	34,173,017.35	3.63
8	其他各项资产	1,849,683.96	0.20
9	合计	942,148,752.22	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	4,942,176.00	0.54
B	采矿业	45,883,232.00	5.02
C	制造业	527,383,736.89	57.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,984,454.00	3.06
E	建筑业	17,280,056.00	1.89
F	批发和零售业	6,414,354.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	31,681,012.00	3.47
H	住宿和餐饮业	780,609.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,296,390.89	6.60
J	金融业	144,544,801.00	15.81
K	房地产业	9,499,120.00	1.04
L	租赁和商务服务业	10,067,499.20	1.10
M	科学研究和技术服务业	10,101,732.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	1,990,032.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	597,618.00	0.07
Q	卫生和社会工作	3,451,278.00	0.38

R	文化、体育和娱乐业	2,865,443.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	905,763,543.98	99.07

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	343,237.43	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	362,307.93	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	600519	贵州茅台	24,900	35,097,048.00	3.84
2	300750	宁德时代	104,600	26,382,212.00	2.89
3	601318	中国平安	426,000	23,634,480.00	2.59
4	600036	招商银行	489,900	22,510,905.00	2.46
5	601166	兴业银行	657,800	15,353,052.00	1.68
6	600900	长江电力	484,200	14,593,788.00	1.60
7	000333	美的集团	194,700	14,057,340.00	1.54
8	601899	紫金矿业	652,000	12,714,000.00	1.39
9	002594	比亚迪	35,800	11,882,378.00	1.30
10	600030	中信证券	386,400	10,672,368.00	1.17
11	601398	工商银行	1,387,400	10,530,366.00	1.15
12	600276	恒瑞医药	176,700	9,170,730.00	1.00
13	000858	五粮液	76,900	9,143,410.00	1.00
14	300059	东方财富	391,700	9,060,021.00	0.99
15	601328	交通银行	1,055,900	8,447,200.00	0.92
16	000651	格力电器	177,300	7,964,316.00	0.87
17	601288	农业银行	1,263,600	7,429,968.00	0.81
18	600887	伊利股份	250,400	6,981,152.00	0.76
19	002475	立讯精密	200,800	6,965,752.00	0.76
20	600919	江苏银行	581,100	6,938,334.00	0.76
21	688981	中芯国际	78,632	6,932,983.44	0.76
22	603259	药明康德	98,900	6,878,495.00	0.75

23	601816	京沪高铁	1,162,000	6,681,500.00	0.73
24	600000	浦发银行	464,700	6,450,036.00	0.71
25	000725	京东方 A	1,453,600	5,799,864.00	0.63
26	002371	北方华创	12,700	5,616,067.00	0.61
27	300760	迈瑞医疗	24,000	5,394,000.00	0.59
28	601088	中国神华	130,600	5,294,524.00	0.58
29	688041	海光信息	36,871	5,209,503.59	0.57
30	300308	中际旭创	35,200	5,134,272.00	0.56
31	601601	中国太保	135,500	5,082,605.00	0.56
32	300502	新易盛	39,200	4,979,184.00	0.54
33	688256	寒武纪	8,233	4,952,149.50	0.54
34	300124	汇川技术	74,700	4,823,379.00	0.53
35	601728	中国电信	614,600	4,763,150.00	0.52
36	601668	中国建筑	817,800	4,718,706.00	0.52
37	002352	顺丰控股	95,300	4,646,828.00	0.51
38	000001	平安银行	384,000	4,634,880.00	0.51
39	002714	牧原股份	108,100	4,541,281.00	0.50
40	002230	科大讯飞	91,500	4,381,020.00	0.48
41	601127	赛力斯	32,300	4,338,536.00	0.47
42	603501	豪威集团	33,700	4,301,805.00	0.47
43	600031	三一重工	234,800	4,214,660.00	0.46
44	000063	中兴通讯	127,500	4,142,475.00	0.45
45	603019	中科曙光	57,900	4,076,160.00	0.45
46	002415	海康威视	146,200	4,054,126.00	0.44
47	600309	万华化学	74,600	4,047,796.00	0.44
48	600941	中国移动	35,700	4,018,035.00	0.44
49	300274	阳光电源	57,400	3,889,998.00	0.43
50	601857	中国石油	448,700	3,836,385.00	0.42
51	601919	中远海控	249,600	3,753,984.00	0.41
52	688008	澜起科技	45,354	3,719,028.00	0.41
53	600690	海尔智家	148,500	3,679,830.00	0.40

54	600660	福耀玻璃	63,400	3,614,434.00	0.40
55	601012	隆基绿能	239,900	3,603,298.00	0.39
56	600406	国电南瑞	159,000	3,563,190.00	0.39
57	601766	中国中车	481,500	3,389,760.00	0.37
58	603986	兆易创新	26,300	3,327,739.00	0.36
59	600050	中国联通	618,800	3,304,392.00	0.36
60	000568	泸州老窖	29,100	3,299,940.00	0.36
61	000338	潍柴动力	214,500	3,299,010.00	0.36
62	600028	中国石化	577,300	3,255,972.00	0.36
63	300476	胜宏科技	23,900	3,211,682.00	0.35
64	601988	中国银行	566,600	3,184,292.00	0.35
65	601006	大秦铁路	478,500	3,158,100.00	0.35
66	000100	TCL科技	727,700	3,150,941.00	0.34
67	688012	中微公司	17,256	3,145,768.80	0.34
68	601985	中国核电	325,600	3,034,592.00	0.33
69	601225	陕西煤业	153,500	2,953,340.00	0.32
70	600104	上汽集团	183,200	2,940,360.00	0.32
71	002027	分众传媒	397,300	2,900,290.00	0.32
72	600150	中国船舶	88,500	2,879,790.00	0.31
73	600418	江淮汽车	69,100	2,770,219.00	0.30
74	601628	中国人寿	65,900	2,714,421.00	0.30
75	605499	东鹏饮料	8,200	2,575,210.00	0.28
76	603288	海天味业	66,000	2,568,060.00	0.28
77	600760	中航沈飞	43,700	2,561,694.00	0.28
78	688111	金山办公	9,135	2,558,256.75	0.28
79	000425	徐工机械	325,600	2,529,912.00	0.28
80	000625	长安汽车	196,500	2,507,340.00	0.27
81	000792	盐湖股份	146,600	2,503,928.00	0.27
82	600111	北方稀土	100,200	2,494,980.00	0.27
83	688271	联影医疗	19,504	2,491,440.96	0.27
84	600938	中国海油	94,600	2,470,006.00	0.27

85	600905	三峡能源	566,400	2,412,864.00	0.26
86	600436	片仔癀	12,000	2,400,120.00	0.26
87	601658	邮储银行	436,400	2,387,108.00	0.26
88	002625	光启技术	59,700	2,386,806.00	0.26
89	600089	特变电工	200,000	2,386,000.00	0.26
90	601888	中国中免	38,600	2,353,442.00	0.26
91	603993	洛阳钼业	278,100	2,341,602.00	0.26
92	002050	三花智控	88,600	2,337,268.00	0.26
93	300033	同花顺	8,500	2,320,585.00	0.25
94	600048	保利发展	284,300	2,302,830.00	0.25
95	300015	爱尔眼科	184,500	2,302,560.00	0.25
96	600547	山东黄金	71,600	2,286,188.00	0.25
97	600019	宝钢股份	346,900	2,286,071.00	0.25
98	601390	中国中铁	406,400	2,279,904.00	0.25
99	002463	沪电股份	53,300	2,269,514.00	0.25
100	002241	歌尔股份	96,700	2,255,044.00	0.25
101	600415	小商品城	108,500	2,243,780.00	0.25
102	300014	亿纬锂能	48,600	2,226,366.00	0.24
103	601600	中国铝业	313,800	2,209,152.00	0.24
104	601989	中国重工	451,300	2,094,032.00	0.23
105	000977	浪潮信息	40,700	2,070,816.00	0.23
106	600585	海螺水泥	95,000	2,039,650.00	0.22
107	002384	东山精密	54,000	2,039,580.00	0.22
108	600893	航发动力	52,800	2,034,912.00	0.22
109	002179	中航光电	50,300	2,030,108.00	0.22
110	600570	恒生电子	59,900	2,009,046.00	0.22
111	603799	华友钴业	53,900	1,995,378.00	0.22
112	000538	云南白药	35,300	1,969,387.00	0.22
113	600584	长电科技	56,700	1,910,223.00	0.21
114	000938	紫光股份	79,300	1,902,407.00	0.21
115	000988	华工科技	39,800	1,870,998.00	0.20

116	601727	上海电气	250,500	1,851,195.00	0.20
117	002028	思源电气	24,700	1,800,877.00	0.20
118	600438	通威股份	106,900	1,790,575.00	0.20
119	300408	三环集团	53,100	1,773,540.00	0.19
120	002049	紫光国微	26,900	1,771,634.00	0.19
121	300433	蓝思科技	78,900	1,759,470.00	0.19
122	000002	万 科 A	269,400	1,729,548.00	0.19
123	600795	国电电力	352,900	1,708,036.00	0.19
124	600489	中金黄金	115,100	1,683,913.00	0.18
125	601669	中国电建	340,900	1,660,183.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	65,800	1,637,104.00	0.18
127	601689	拓普集团	34,400	1,625,400.00	0.18
128	600010	包钢股份	896,300	1,604,377.00	0.18
129	300339	润和软件	31,500	1,601,145.00	0.18
130	002422	科伦药业	44,300	1,591,256.00	0.17
131	600009	上海机场	49,300	1,566,261.00	0.17
132	002456	欧菲光	131,800	1,561,830.00	0.17
133	601100	恒立液压	21,300	1,533,600.00	0.17
134	600160	巨化股份	53,400	1,531,512.00	0.17
135	002460	赣锋锂业	44,800	1,512,896.00	0.17
136	000768	中航西飞	55,000	1,503,700.00	0.16
137	300394	天孚通信	18,480	1,475,443.20	0.16
138	601186	中国铁建	182,100	1,458,621.00	0.16
139	600183	生益科技	48,100	1,450,215.00	0.16
140	002252	上海莱士	210,200	1,444,074.00	0.16
141	688036	传音控股	17,991	1,433,882.70	0.16
142	000157	中联重科	196,600	1,421,418.00	0.16
143	600839	四川长虹	146,200	1,421,064.00	0.16
144	601360	三六零	138,500	1,412,700.00	0.15
145	600989	宝丰能源	87,100	1,405,794.00	0.15
146	000963	华东医药	34,700	1,400,492.00	0.15

147	600886	国投电力	95,000	1,400,300.00	0.15
148	002074	国轩高科	42,900	1,392,534.00	0.15
149	601058	赛轮轮胎	104,200	1,367,104.00	0.15
150	600115	中国东航	338,700	1,364,961.00	0.15
151	300442	润泽科技	27,300	1,352,169.00	0.15
152	000408	藏格矿业	31,100	1,327,037.00	0.15
153	000807	云铝股份	82,400	1,316,752.00	0.14
154	002466	天齐锂业	40,900	1,310,436.00	0.14
155	600066	宇通客车	52,600	1,307,636.00	0.14
156	002001	新 和 成	60,800	1,293,216.00	0.14
157	000661	长春高新	13,000	1,289,340.00	0.14
158	002340	格林美	202,900	1,288,415.00	0.14
159	688169	石头科技	8,165	1,278,230.75	0.14
160	600426	华鲁恒升	58,800	1,274,196.00	0.14
161	002195	岩山科技	224,900	1,266,187.00	0.14
162	002558	巨人网络	53,600	1,262,280.00	0.14
163	600196	复星医药	50,300	1,262,027.00	0.14
164	001979	招商蛇口	143,500	1,258,495.00	0.14
165	600029	南方航空	213,300	1,258,470.00	0.14
166	601800	中国交建	140,800	1,251,712.00	0.14
167	300661	圣邦股份	17,180	1,250,188.60	0.14
168	000975	山金国际	65,900	1,248,146.00	0.14
169	002236	大华股份	78,400	1,244,992.00	0.14
170	600011	华能国际	174,100	1,243,074.00	0.14
171	301236	软通动力	22,700	1,240,328.00	0.14
172	600674	川投能源	77,200	1,238,288.00	0.14
173	002156	通富微电	48,100	1,232,322.00	0.13
174	688126	沪硅产业	65,249	1,221,461.28	0.13
175	002517	恺英网络	62,400	1,204,944.00	0.13
176	600487	亨通光电	78,100	1,194,930.00	0.13
177	600346	恒力石化	83,600	1,192,136.00	0.13

178	300251	光线传媒	58,100	1,177,687.00	0.13
179	300207	欣旺达	58,400	1,171,504.00	0.13
180	300418	昆仑万维	34,800	1,170,324.00	0.13
181	601111	中国国航	148,300	1,170,087.00	0.13
182	600745	闻泰科技	34,500	1,156,785.00	0.13
183	002648	卫星化学	66,600	1,154,178.00	0.13
184	600372	中航机载	95,700	1,154,142.00	0.13
185	688608	恒玄科技	3,314	1,153,205.72	0.13
186	601868	中国能建	513,400	1,144,882.00	0.13
187	600460	士兰微	46,100	1,144,202.00	0.13
188	002916	深南电路	10,540	1,136,317.40	0.12
189	688213	思特威	11,095	1,134,130.90	0.12
190	000066	中国长城	76,600	1,133,680.00	0.12
191	003816	中国广核	311,400	1,133,496.00	0.12
192	688777	中控技术	24,946	1,120,324.86	0.12
193	002920	德赛西威	10,900	1,113,217.00	0.12
194	601117	中国化学	145,100	1,112,917.00	0.12
195	600096	云天化	50,500	1,109,485.00	0.12
196	688120	华海清科	6,536	1,102,623.20	0.12
197	600741	华域汽车	62,400	1,101,360.00	0.12
198	601319	中国人保	126,400	1,100,944.00	0.12
199	002273	水晶光电	55,100	1,100,347.00	0.12
200	601168	西部矿业	66,000	1,097,580.00	0.12
201	002465	海格通信	78,600	1,095,684.00	0.12
202	600879	航天电子	104,500	1,094,115.00	0.12
203	300347	泰格医药	20,500	1,093,060.00	0.12
204	600588	用友网络	81,200	1,085,644.00	0.12
205	600256	广汇能源	180,000	1,083,600.00	0.12
206	600176	中国巨石	95,000	1,083,000.00	0.12
207	601021	春秋航空	19,400	1,079,610.00	0.12
208	300450	先导智能	43,400	1,078,490.00	0.12

209	002601	龙佰集团	66,100	1,071,481.00	0.12
210	300782	卓胜微	14,900	1,063,413.00	0.12
211	000831	中国稀土	29,400	1,061,928.00	0.12
212	000786	北新建材	40,100	1,061,848.00	0.12
213	601633	长城汽车	49,400	1,061,112.00	0.12
214	688235	百济神州	4,538	1,060,258.32	0.12
215	002555	三七互娱	61,300	1,059,877.00	0.12
216	600219	南山铝业	275,800	1,056,314.00	0.12
217	300896	爱美客	6,000	1,048,860.00	0.11
218	600352	浙江龙盛	103,100	1,047,496.00	0.11
219	002294	信立泰	22,100	1,045,993.00	0.11
220	300017	网宿科技	96,800	1,037,696.00	0.11
221	000933	神火股份	62,300	1,036,672.00	0.11
222	600885	宏发股份	46,220	1,031,168.20	0.11
223	600482	中国动力	44,600	1,028,922.00	0.11
224	302132	中航成飞	11,700	1,028,898.00	0.11
225	002185	华天科技	101,500	1,025,150.00	0.11
226	600039	四川路桥	103,500	1,024,650.00	0.11
227	000630	铜陵有色	300,600	1,004,004.00	0.11
228	688002	睿创微纳	14,388	1,003,131.36	0.11
229	688617	惠泰医疗	3,337	991,089.00	0.11
230	688396	华润微	20,945	987,766.20	0.11
231	002129	TCL中环	128,000	983,040.00	0.11
232	002493	荣盛石化	118,600	982,008.00	0.11
233	600085	同仁堂	27,100	977,226.00	0.11
234	001965	招商公路	81,000	972,000.00	0.11
235	601877	正泰电器	42,500	963,475.00	0.11
236	002709	天赐材料	53,100	962,172.00	0.11
237	600362	江西铜业	41,000	960,630.00	0.11
238	300866	安克创新	8,400	954,240.00	0.10
239	002130	沃尔核材	39,900	950,418.00	0.10

240	002281	光迅科技	19,200	946,944.00	0.10
241	688099	晶晨股份	13,288	943,580.88	0.10
242	300454	深信服	10,000	941,800.00	0.10
243	002595	豪迈科技	15,900	941,598.00	0.10
244	002131	利欧股份	268,000	938,000.00	0.10
245	688506	百利天恒	3,163	936,627.56	0.10
246	000423	东阿阿胶	17,900	936,170.00	0.10
247	002085	万丰奥威	58,800	934,332.00	0.10
248	688122	西部超导	17,937	930,571.56	0.10
249	300122	智飞生物	47,400	928,566.00	0.10
250	300223	北京君正	13,400	927,280.00	0.10
251	603392	万泰生物	15,100	921,100.00	0.10
252	002738	中矿资源	28,600	919,776.00	0.10
253	300058	蓝色光标	140,020	918,531.20	0.10
254	002532	天山铝业	110,500	918,255.00	0.10
255	300002	神州泰岳	77,700	916,860.00	0.10
256	300474	景嘉微	12,500	912,500.00	0.10
257	603129	春风动力	4,200	909,300.00	0.10
258	002180	纳思达	39,400	903,836.00	0.10
259	600161	天坛生物	47,000	901,930.00	0.10
260	002472	双环传动	26,800	897,532.00	0.10
261	002138	顺络电子	31,900	897,028.00	0.10
262	002078	太阳纸业	66,300	892,398.00	0.10
263	603596	伯特利	16,800	885,192.00	0.10
264	300832	新产业	15,600	884,832.00	0.10
265	002436	兴森科技	66,800	884,432.00	0.10
266	002938	鹏鼎控股	27,500	880,825.00	0.10
267	600233	圆通速递	68,200	879,098.00	0.10
268	002128	电投能源	44,400	878,232.00	0.10
269	002410	广联达	65,400	877,014.00	0.10
270	000301	东方盛虹	104,700	872,151.00	0.10

271	300346	南大光电	27,320	864,404.80	0.09
272	600862	中航高科	33,100	863,248.00	0.09
273	600143	金发科技	83,500	860,885.00	0.09
274	600188	兖矿能源	70,700	860,419.00	0.09
275	300759	康龙化成	35,000	858,900.00	0.09
276	300136	信维通信	38,300	857,920.00	0.09
277	002065	东华软件	88,800	852,480.00	0.09
278	300024	机器人	49,600	852,128.00	0.09
279	300054	鼎龙股份	29,700	851,796.00	0.09
280	002353	杰瑞股份	24,300	850,500.00	0.09
281	300395	菲利华	16,600	848,260.00	0.09
282	603606	东方电缆	16,400	848,044.00	0.09
283	688072	拓荆科技	5,517	848,018.07	0.09
284	002223	鱼跃医疗	23,800	847,280.00	0.09
285	000034	神州数码	22,500	846,900.00	0.09
286	688047	龙芯中科	6,327	843,958.53	0.09
287	601618	中国中冶	282,700	842,446.00	0.09
288	002202	金风科技	82,000	840,500.00	0.09
289	300496	中科创达	14,600	835,412.00	0.09
290	000999	华润三九	26,480	828,294.40	0.09
291	601615	明阳智能	72,000	827,280.00	0.09
292	688578	艾力斯	8,875	825,730.00	0.09
293	688223	晶科能源	158,486	822,542.34	0.09
294	002624	完美世界	53,800	816,146.00	0.09
295	300383	光环新网	56,900	813,670.00	0.09
296	002271	东方雨虹	75,700	812,261.00	0.09
297	002008	大族激光	33,300	811,521.00	0.09
298	600845	宝信软件	34,200	807,804.00	0.09
299	002405	四维图新	93,900	801,906.00	0.09
300	601872	招商轮船	127,900	800,654.00	0.09
301	600515	海南机场	226,100	800,394.00	0.09

302	603659	璞泰来	42,200	792,516.00	0.09
303	600549	厦门钨业	37,700	788,684.00	0.09
304	600895	张江高科	30,600	786,420.00	0.09
305	300604	长川科技	17,500	785,925.00	0.09
306	688266	泽璟制药	7,309	785,790.59	0.09
307	002459	晶澳科技	78,600	784,428.00	0.09
308	603087	甘李药业	14,300	783,354.00	0.09
309	300459	汤姆猫	139,200	779,520.00	0.09
310	300012	华测检测	66,600	778,554.00	0.09
311	603605	珀莱雅	9,400	778,226.00	0.09
312	000426	兴业银锡	49,200	777,360.00	0.09
313	002155	湖南黄金	43,300	772,905.00	0.08
314	000733	振华科技	15,400	770,770.00	0.08
315	300627	华测导航	21,720	760,200.00	0.08
316	605117	德业股份	14,400	758,304.00	0.08
317	688599	天合光能	51,776	752,305.28	0.08
318	605589	圣泉集团	26,800	743,700.00	0.08
319	300253	卫宁健康	70,000	742,000.00	0.08
320	601216	君正集团	133,600	737,472.00	0.08
321	600332	白云山	27,800	732,808.00	0.08
322	300699	光威复材	23,100	731,577.00	0.08
323	600392	盛和资源	55,500	730,935.00	0.08
324	000617	中油资本	100,000	730,000.00	0.08
325	300037	新宙邦	20,700	728,640.00	0.08
326	002444	巨星科技	28,400	724,484.00	0.08
327	688180	君实生物	21,160	719,016.80	0.08
328	300003	乐普医疗	52,100	717,938.00	0.08
329	000932	华菱钢铁	162,300	714,120.00	0.08
330	600153	建发股份	68,800	713,456.00	0.08
331	300073	当升科技	16,100	706,307.00	0.08
332	601233	桐昆股份	66,600	705,960.00	0.08

332	000878	云南铜业	55,500	705,960.00	0.08
334	002389	航天彩虹	27,500	704,000.00	0.08
335	300316	晶盛机电	25,900	703,185.00	0.08
336	601799	星宇股份	5,600	700,000.00	0.08
337	300001	特锐德	29,200	699,924.00	0.08
338	002821	凯莱英	7,900	697,175.00	0.08
339	300142	沃森生物	63,300	696,300.00	0.08
340	300628	亿联网络	20,000	695,200.00	0.08
341	600803	新奥股份	36,700	693,630.00	0.08
342	002414	高德红外	67,600	692,900.00	0.08
343	603979	金诚信	14,900	691,956.00	0.08
344	600699	均胜电子	39,000	680,160.00	0.07
345	002007	华兰生物	43,400	680,078.00	0.07
346	300568	星源材质	53,200	674,576.00	0.07
347	002812	恩捷股份	23,000	673,670.00	0.07
348	000519	中兵红箭	30,700	672,023.00	0.07
349	600118	中国卫星	23,400	668,538.00	0.07
350	603260	合盛硅业	14,100	668,340.00	0.07
351	600177	雅戈尔	91,500	667,950.00	0.07
352	600521	华海药业	35,800	666,954.00	0.07
353	002152	广电运通	49,200	661,248.00	0.07
354	600398	海澜之家	95,000	661,200.00	0.07
355	601238	广汽集团	87,700	656,873.00	0.07
356	300315	掌趣科技	107,700	653,739.00	0.07
357	600704	物产中大	123,300	649,791.00	0.07
358	000738	航发控制	31,200	647,400.00	0.07
359	300413	芒果超媒	29,600	645,872.00	0.07
360	600316	洪都航空	17,100	644,670.00	0.07
361	000623	吉林敖东	37,800	640,710.00	0.07
362	600497	驰宏锌锗	120,900	639,561.00	0.07
363	002044	美年健康	123,900	636,846.00	0.07

364	000009	中国宝安	71,500	634,920.00	0.07
365	002318	久立特材	27,100	633,869.00	0.07
366	600038	中直股份	16,300	632,603.00	0.07
367	600018	上港集团	110,600	631,526.00	0.07
368	600765	中航重机	37,400	631,312.00	0.07
369	600141	兴发集团	30,600	628,218.00	0.07
370	601567	三星医疗	27,900	625,518.00	0.07
371	002409	雅克科技	11,300	617,997.00	0.07
372	000400	许继电气	28,200	613,914.00	0.07
373	601677	明泰铝业	49,300	612,306.00	0.07
374	300919	中伟股份	18,600	611,568.00	0.07
375	300757	罗博特科	4,000	599,880.00	0.07
376	688188	柏楚电子	4,550	599,053.00	0.07
377	002607	中公教育	195,300	597,618.00	0.07
378	300724	捷佳伟创	11,000	597,300.00	0.07
379	600637	东方明珠	79,900	596,853.00	0.07
380	000960	锡业股份	39,000	596,700.00	0.07
381	601607	上海医药	33,100	591,828.00	0.06
382	600498	烽火通信	28,100	590,943.00	0.06
383	300088	长信科技	98,800	588,848.00	0.06
384	603939	益丰药房	24,000	587,280.00	0.06
385	002245	蔚蓝锂芯	45,600	585,048.00	0.06
386	600529	山东药玻	26,300	582,282.00	0.06
387	300182	捷成股份	105,500	581,305.00	0.06
388	300558	贝达药业	10,000	579,500.00	0.06
389	600563	法拉电子	5,300	578,177.00	0.06
390	002407	多氟多	47,200	575,368.00	0.06
391	002841	视源股份	16,600	574,360.00	0.06
392	002739	万达电影	50,200	573,786.00	0.06
393	600026	中远海能	55,000	568,150.00	0.06
394	000039	中集集团	72,100	566,706.00	0.06

395	300068	南都电源	35,500	565,160.00	0.06
396	601018	宁波港	154,000	563,640.00	0.06
397	301358	湖南裕能	18,000	561,420.00	0.06
398	600486	扬农化工	9,600	556,800.00	0.06
399	002025	航天电器	10,800	555,228.00	0.06
400	000887	中鼎股份	31,300	550,567.00	0.06
401	300285	国瓷材料	31,600	548,260.00	0.06
402	300763	锦浪科技	9,500	545,205.00	0.06
403	688303	大全能源	25,384	541,186.88	0.06
404	603806	福斯特	41,300	535,248.00	0.06
405	300144	宋城演艺	62,300	532,665.00	0.06
406	600820	隧道股份	87,100	531,310.00	0.06
407	603486	科沃斯	9,100	529,893.00	0.06
408	688009	中国通号	102,449	526,587.86	0.06
409	600008	首创环保	174,300	526,386.00	0.06
410	300296	利亚德	85,900	523,990.00	0.06
411	002497	雅化集团	45,700	520,980.00	0.06
412	002064	华峰化学	78,600	519,546.00	0.06
413	600516	方大炭素	111,600	517,824.00	0.06
414	002312	川发龙蟒	44,900	515,452.00	0.06
415	603568	伟明环保	27,000	515,160.00	0.06
416	600998	九州通	99,800	512,972.00	0.06
417	600763	通策医疗	12,400	511,872.00	0.06
418	600166	福田汽车	188,100	509,751.00	0.06
419	600170	上海建工	211,000	504,290.00	0.06
420	603816	顾家家居	19,600	500,192.00	0.05
421	601179	中国西电	81,200	498,568.00	0.05
422	600208	衢州发展	168,400	498,464.00	0.05
423	605358	立昂微	21,300	496,290.00	0.05
424	600312	平高电气	32,200	495,558.00	0.05
425	000683	博源化工	103,100	493,849.00	0.05

426	300676	华大基因	9,900	492,723.00	0.05
427	002176	江特电机	67,500	490,050.00	0.05
428	601155	新城控股	35,800	489,744.00	0.05
429	002432	九安医疗	13,200	480,876.00	0.05
430	002244	滨江集团	49,300	480,675.00	0.05
431	601000	唐山港	117,300	476,238.00	0.05
432	600323	瀚蓝环境	19,400	472,390.00	0.05
433	603613	国联股份	19,900	471,431.00	0.05
434	000629	钒钛股份	183,900	470,784.00	0.05
435	000818	航锦科技	20,900	470,250.00	0.05
436	000708	中信特钢	39,900	469,224.00	0.05
437	603885	吉祥航空	34,800	468,756.00	0.05
438	000830	鲁西化工	45,400	467,620.00	0.05
439	300567	精测电子	7,700	466,697.00	0.05
440	002603	以岭药业	33,000	465,300.00	0.05
441	600535	天士力	29,600	463,240.00	0.05
442	002439	启明星辰	28,800	460,512.00	0.05
443	600499	科达制造	45,600	446,880.00	0.05
444	601880	辽港股份	296,800	445,200.00	0.05
445	603000	人民网	21,900	442,599.00	0.05
446	688005	容百科技	19,734	440,462.88	0.05
447	300390	天华新能	23,000	438,610.00	0.05
448	002145	中核钛白	105,500	437,825.00	0.05
449	600511	国药股份	15,000	437,400.00	0.05
450	000563	陕国投 A	121,400	433,398.00	0.05
451	600859	王府井	31,100	431,979.00	0.05
452	600655	豫园股份	77,200	428,460.00	0.05
453	603077	和邦生物	244,600	428,050.00	0.05
454	600004	白云机场	46,900	426,790.00	0.05
455	601966	玲珑轮胎	29,000	425,430.00	0.05
456	000547	航天发展	50,600	425,040.00	0.05

457	600325	华发股份	87,100	424,177.00	0.05
458	603899	晨光股份	14,600	423,254.00	0.05
459	600131	国网信通	23,800	421,260.00	0.05
460	300529	健帆生物	19,000	409,830.00	0.04
461	002756	永兴材料	12,900	409,575.00	0.04
462	603833	欧派家居	7,200	406,440.00	0.04
463	600754	锦江酒店	18,100	406,164.00	0.04
464	300601	康泰生物	26,500	402,535.00	0.04
465	000998	隆平高科	40,700	400,895.00	0.04
466	300070	碧水源	86,100	387,450.00	0.04
467	300438	鹏辉能源	14,000	386,540.00	0.04
468	002120	韵达股份	57,400	384,580.00	0.04
469	601866	中远海发	155,700	384,579.00	0.04
470	600667	太极实业	58,400	384,272.00	0.04
471	300751	迈为股份	5,500	382,580.00	0.04
472	600867	通化东宝	46,600	382,120.00	0.04
473	002544	普天科技	16,200	379,890.00	0.04
474	600258	首旅酒店	26,500	374,445.00	0.04
475	000032	深桑达 A	18,100	366,163.00	0.04
476	000069	华侨城 A	159,100	357,975.00	0.04
477	300457	赢合科技	15,500	356,500.00	0.04
478	002508	老板电器	18,700	355,487.00	0.04
479	300573	兴齐眼药	6,740	349,064.60	0.04
480	000967	盈峰环境	50,200	348,890.00	0.04
481	002831	裕同科技	14,800	346,616.00	0.04
482	300118	东方日升	36,100	345,838.00	0.04
483	002292	奥飞娱乐	35,100	341,172.00	0.04
484	600129	太极集团	15,500	330,305.00	0.04
485	002572	索菲亚	22,900	320,829.00	0.04
486	601636	旗滨集团	63,700	319,137.00	0.03
487	002266	浙富控股	103,300	318,164.00	0.03

488	603650	彤程新材	9,500	305,425.00	0.03
489	688063	派能科技	6,774	305,371.92	0.03
490	000035	中国天楹	69,200	296,868.00	0.03
491	600864	哈投股份	49,400	294,918.00	0.03
492	688390	固德威	6,698	291,028.10	0.03
493	300769	德方纳米	8,800	290,576.00	0.03
494	600315	上海家化	13,400	282,338.00	0.03
495	002091	江苏国泰	38,600	280,622.00	0.03
496	002372	伟星新材	25,200	261,072.00	0.03
497	001914	招商积余	16,800	207,816.00	0.02
498	600007	中国国贸	7,900	162,582.00	0.02
499	600335	国机汽车	23,700	152,865.00	0.02
500	301381	赛维时代	4,700	93,765.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301662	宏工科技	1,429	147,882.02	0.02
2	688775	影石创新	353	43,828.48	0.00
3	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
4	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
5	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
6	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
7	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
8	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
9	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
10	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
11	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
12	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00

13	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
14	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
15	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
16	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
17	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
18	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
19	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
20	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
21	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
22	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
23	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	600519	贵州茅台	70,746,039.00	9.81
2	601318	中国平安	39,125,266.73	5.43
3	600036	招商银行	35,917,896.00	4.98
4	600900	长江电力	24,971,171.00	3.46
5	601166	兴业银行	23,166,156.52	3.21
6	300750	宁德时代	20,962,843.60	2.91
7	601899	紫金矿业	19,656,890.99	2.73
8	300059	东方财富	19,416,299.86	2.69
9	600030	中信证券	18,354,071.31	2.55
10	601398	工商银行	16,845,085.00	2.34
11	600276	恒瑞医药	14,423,770.60	2.00
12	601328	交通银行	13,543,518.00	1.88
13	600887	伊利股份	12,813,019.00	1.78

14	688041	海光信息	12,433,912.51	1.72
15	688981	中芯国际	12,180,999.26	1.69
16	601288	农业银行	11,965,361.00	1.66
17	601816	京沪高铁	11,900,355.00	1.65
18	000333	美的集团	11,349,109.34	1.57
19	600919	江苏银行	10,648,519.00	1.48
20	601088	中国神华	9,870,986.00	1.37

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	600519	贵州茅台	38,149,546.25	5.29
2	601318	中国平安	18,226,564.92	2.53
3	600036	招商银行	16,684,216.00	2.31
4	600900	长江电力	11,694,757.00	1.62
5	601166	兴业银行	9,878,401.00	1.37
6	601899	紫金矿业	9,161,124.00	1.27
7	600030	中信证券	8,855,174.25	1.23
8	601398	工商银行	7,777,865.00	1.08
9	688041	海光信息	7,645,299.56	1.06
10	600436	片仔癀	7,224,935.86	1.00
11	600276	恒瑞医药	6,660,684.80	0.92
12	688981	中芯国际	6,235,755.74	0.86
13	600887	伊利股份	6,174,831.00	0.86
14	300059	东方财富	5,969,652.45	0.83
15	601328	交通银行	5,805,912.00	0.81
16	601816	京沪高铁	5,614,947.00	0.78
17	601288	农业银行	5,419,923.09	0.75

18	600309	万华化学	5,101,540.00	0.71
19	002371	北方华创	5,016,191.00	0.70
20	601088	中国神华	4,930,412.37	0.68

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	1,271,136,939.50
卖出股票收入（成交）总额	526,428,776.82

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

兴业银行：2024年12月26日，国家金融监督管理总局对兴业银行股份有限公司处以行政处罚。2024年7月17日，国家金融监督管理总局福建监管局对兴业银行股份有限公司处以行政处罚。

中信证券：2024年12月20日，中国证券监督管理委员会深圳监管局对中信证券股份有限公司采取出具警示函的监管措施。

本基金为指数型基金，采取完全复制策略，跟踪的标的指数为中证A500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	1,849,683.96
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	1,849,683.96

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	688775	影石创新	43,828.48	0.00	新股限售
2	301275	汉朔科技	22,307.43	0.00	新股限售
3	301678	新恒汇	17,014.28	0.00	新股限售
4	301501	恒鑫生活	15,781.78	0.00	新股限售
5	301662	宏工科技	11,797.50	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)	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 A500交易型开 放式指数证券 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
1,613	534,906.59	835,662,466.00	96.85%	27,141,871.00	3.15%	80,994,500.00	9.39%

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A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金”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	750,186,236.00	86.95%
2	嘉善恒源投资有限公司	2,000,233.00	0.23%
3	北京博润银泰投资管理有限公司－博润银泰多策略5号私募基金	1,496,700.00	0.17%
4	乔宁	1,000,068.00	0.12%
5	王越昊	972,501.00	0.11%
6	王子欢	668,000.00	0.08%
7	珠海六点智能科技有限公司	500,053.00	0.06%
8	李然	500,029.00	0.06%
9	张志芬	495,900.00	0.06%
10	杨露冰	495,019.00	0.06%
11	国信证券股份有限公司－西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	80,994,500.00	9.39%

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	-	-

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
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12月30日)基金份额总额	721,804,337.00
本报告期期初基金份额总额	721,804,337.00
本报告期基金总申购份额	843,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	702,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	862,804,337.00

§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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东财证券	6	1,796,579,815.20	100.00%	348,124.53	100.00%	-

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况等因素的基础上，选择证券经纪商。
- 3、选择券商的程序：

(1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；

(2) 本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东财证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证监会规定网站及报刊	2025-01-03
2	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	证监会规定网站	2025-01-03

3	关于西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	证监会规定网站及报刊	2025-01-08
4	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2025-01-09
5	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
6	关于西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	证监会规定网站及报刊	2025-03-03
7	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
8	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
9	西藏东财中证A500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
10	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
11	西藏东财中证A500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
12	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2025-06-28

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	2025-01-14至2025-06-30	100,004,861.00	791,988,802.00	141,807,427.00	750,186,236.00	86.95%
ETF联接基金	1	2025-05-27至2025-05-29	-	178,031,600.00	97,037,100.00	80,994,500.00	9.39%
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A500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A500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A500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