
西藏东财沪深 300 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	8
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	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	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	59

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	沪深300ETF基金
场内简称	沪深300ETF基金
基金主代码	159330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年08月01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	1,160,801,009.00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08月19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	沪深300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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金中期报告备置地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	7,928,645.63
本期利润	22,753,850.19
加权平均基金份额本期利润	0.0268
本期加权平均净值利润率	2.31%
本期基金份额净值增长率	1.40%
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	-9,922,849.10
期末可供分配基金份额利润	-0.0085
期末基金资产净值	1,385,214,046.93
期末基金份额净值	1.1933
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	19.33%

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。

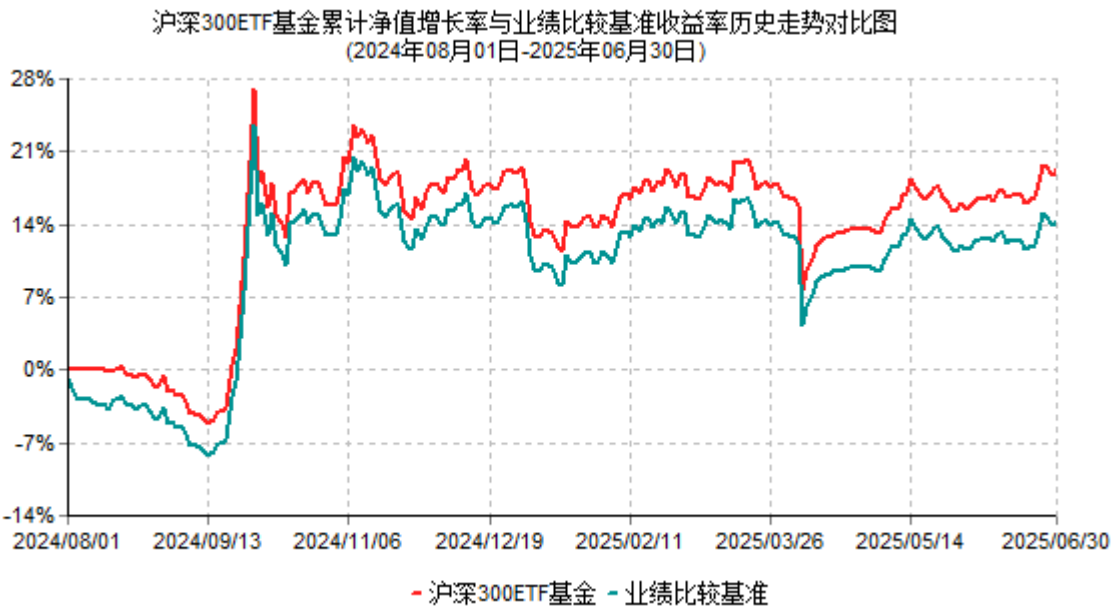
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	3.38%	0.58%	2.50%	0.58%	0.88%	0.00%
过去三个月	2.37%	1.10%	1.25%	1.10%	1.12%	0.00%
过去六个月	1.40%	1.01%	0.03%	1.02%	1.37%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	19.33%	1.41%	14.35%	1.43%	4.98%	-0.02%

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8月1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	2024-08-01	-	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	2024-08-19	-	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沪深300指数，该指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具代表性的300只证券组成，于2005年4月8日正式发布，以反映沪深市场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，沪深300ETF基金份额净值为1.1933元，报告期内基金份额净值增长率为1.40%，同期业绩比较基准收益率为0.03%。

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

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的真实、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：西藏东财沪深300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	38,207,930.95	8,799,742.35
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,374,022,360.99	989,635,798.50
其中：股票投资		1,374,022,360.99	989,635,798.50
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		3,882,673.50	-
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		1,416,112,965.44	998,435,540.85
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		-	271,031.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		401,547.59	434,448.98
应付托管费		40,154.75	43,444.92
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	30,457,216.17	2,319,565.09
负债合计		30,898,918.51	3,068,490.23

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,160,801,009.00	845,801,009.00
未分配利润	6.4.7.8	224,413,037.93	149,566,041.62
净资产合计		1,385,214,046.93	995,367,050.62
负债和净资产总计		1,416,112,965.44	998,435,540.85

注：报告截止日2025年6月30日，基金份额净值人民币1.1933元，基金份额总额1,160,801,009.00份。

6.2 利润表

会计主体：西藏东财沪深300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06月30日
一、营业总收入		25,536,352.68
1.利息收入		21,110.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	21,110.88
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）		9,816,219.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,122,824.75
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	12,939,044.47
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	14,825,204.56
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	873,817.52
减：二、营业总支出		2,782,502.49
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,448,402.11
2.托管费	6.4.10.2.2	244,840.23
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	89,260.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,753,850.19
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,753,850.19
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		22,753,850.19

注：本基金基金合同生效日为2024年8月1日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：西藏东财沪深300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	845,801,009.00	149,566,041.62	995,367,050.62

二、本期期初净资产	845,801,009.00	149,566,041.62	995,367,050.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	315,000,000.00	74,846,996.31	389,846,996.31
（一）、综合收益总额	-	22,753,850.19	22,753,850.19
（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）	315,000,000.00	52,093,146.12	367,093,146.12
其中：1.基金申购款	678,000,000.00	115,237,337.16	793,237,337.16
2.基金赎回款	-363,000,000.00	-63,144,191.04	-426,144,191.04
（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	1,160,801,009.00	224,413,037.93	1,385,214,046.93

注：本基金基金合同生效日为2024年8月1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

西藏东财沪深300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《西藏东财沪深300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”）、《西藏东财沪深300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]851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248,801,009.00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00125号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2024年8月1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）。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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：沪深300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	1,000,303.12
等于：本金	999,983.24
加：应计利息	319.88
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	37,207,627.83

等于：本金	37,205,814.24
加：应计利息	1,813.59
减：坏账准备	-
合计	38,207,930.95

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		1,372,195,173.06	-	1,374,022,360.99	1,827,187.93
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		1,372,195,173.06	-	1,374,022,360.99	1,827,187.93

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	29,752.78
预提费用-信息披露费	109,507.37
可退替代款	58,144.50
应退替代款	30,221,897.81
其他应付	37,913.71
合计	30,457,216.17

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	845,801,009.00	845,801,009.00
本期申购	678,000,000.00	678,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-363,000,000.00	-363,000,000.00
本期末	1,160,801,009.00	1,160,801,009.00

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	-14,951,402.49	164,517,444.11	149,566,041.62
本期期初	-14,951,402.49	164,517,444.11	149,566,041.62
本期利润	7,928,645.63	14,825,204.56	22,753,850.19
本期基金份额交易产生的变动数	-2,900,092.24	54,993,238.36	52,093,146.12
其中：基金申购款	-9,127,949.23	124,365,286.39	115,237,337.16
基金赎回款	6,227,856.99	-69,372,048.03	-63,144,191.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,922,849.10	234,335,887.03	224,413,037.93

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	5,834.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	15,276.23
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	21,110.88

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	354,621.40
股票投资收益——赎回差价收入	-3,477,446.15
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	-3,122,824.75

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	339,099,478.45
减：卖出股票成本总额	338,336,986.32
减：交易费用	407,870.73
买卖股票差价收入	354,621.40

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	426,144,191.04
减：现金支付赎回款总额	275,900,086.04
减：赎回股票成本总额	153,721,551.15
减：交易费用	-
赎回差价收入	-3,477,446.15

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	12,939,044.47
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	12,939,044.47

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	14,825,204.56
——股票投资	14,825,204.56
——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	14,825,204.56

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	873,817.52
合计	873,817.52

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	89,260.15

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
西藏东财沪深300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	929,972,803.18	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	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总

		量的比 例		额的比例
东财证券	181,471.04	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	2,448,402.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	109,907.50
应支付基金管理人的净管理费	2,338,494.61

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	244,840.23

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8月1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	716,263,061.00	61.70%	225,000,000.00	26.60%
西藏东财 沪深300 交易型开 放式指数 证券投资	58,264,540.00	5.02%	77,900,840.00	9.21%

基金发起 式联接基 金				
-------------------	--	--	--	--

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	1,000,303.12	5,834.65
东财证券- 证券资金 户	37,207,627.83	15,276.23

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）822,900股，市值为人民币19,033,677.00元，占本基金资产净值的比例为1.37%。（于上年度末：持有605,300股，市值为人民币15,628,846.00元，占本基金资产净值的比例为1.57%。）

于本报告期末，本基金因指数成份股原因被动持有基金托管人国信证券股份有限公司发行的证券（002736）190,200股，市值为人民币2,191,104.00元，占本基金资产净值的比例为0.16%。（于上年度末：持有138,200股，市值为人民币1,547,840.00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	573	27,085.71	71,143.68	-
688411	海博思创	2025-01-20	6个月	新股限售	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
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	-
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	-
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
3014 79	弘景 光电	2025 -03- 06	6个月	新股 限售	41.9 0	77.8 7	182	5,44 7.00	14,1 72.3 4	其中52 股为锁 定期送 股所得
6887 57	胜科 纳米	2025 -03- 18	6个月	新股 限售	9.08	25.9 4	536	4,86 6.88	13,9 03.8 4	-
0013 88	信通 电子	2025 -06- 24	1个月内 (含)	新股 未上 市	16.4 2	16.4 2	843	13,8 42.0 6	13,8 42.0 6	-
6887 58	赛分 科技	2025 -01- 02	6个月	新股 限售	4.32	16.9 7	777	3,35 6.64	13,1 85.6 9	-
6030 72	天和 磁材	2024 -12- 24	6个月	新股 限售	12.3 0	54.4 5	226	2,77 9.80	12,3 05.7 0	-
3016 62	宏工 科技	2025 -04- 10	6个月	新股 限售	26.6 0	82.5 0	143	3,80 3.80	11,7 97.5 0	-
0013 56	富岭 股份	2025 -01- 16	6个月	新股 限售	5.30	14.4 4	709	3,75 7.70	10,2 37.9 6	-
3015 90	优优 绿能	2025 -05- 28	6个月	新股 限售	89.6 0	139. 48	73	6,54 0.80	10,1 82.0 4	-
6887 55	汉邦 科技	2025 -05- 09	6个月	新股 限售	22.7 7	39.3 3	203	4,62 2.31	7,98 3.99	-
0013 82	新亚 电缆	2025 -03- 13	6个月	新股 限售	7.40	20.2 1	366	2,70 8.40	7,39 6.86	-
6030 14	威高 血净	2025 -05-	6个月	新股 限售	26.5 0	32.6 8	205	5,43 2.50	6,69 9.40	-

		12								
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	-
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	38,207,930.95	-	-	-	38,207,930.95
交易性金融资产	-	-	-	1,374,022,360.99	1,374,022,360.99
应收清算款	-	-	-	3,882,673.50	3,882,673.50
资产总	38,207,930.95	-	-	1,377,905,034.49	1,416,112,965.44

计					
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	401,547.59	401,547.59
应付托管费	-	-	-	40,154.75	40,154.75
其他负债	-	-	-	30,457,216.17	30,457,216.17
负债总计	-	-	-	30,898,918.51	30,898,918.51
利率敏感度缺口	38,207,930.95	-	-	1,347,006,115.98	1,385,214,046.93
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	8,799,742.35	-	-	-	8,799,742.35
交易性金融资产	-	-	-	989,635,798.50	989,635,798.50
资产总计	8,799,742.35	-	-	989,635,798.50	998,435,540.85
负债					
应付清算款	-	-	-	271,031.24	271,031.24
应付管理人报酬	-	-	-	434,448.98	434,448.98
应付托管费	-	-	-	43,444.92	43,444.92
其他负债	-	-	-	2,319,565.09	2,319,565.09

负债总计	-	-	-	3,068,490.23	3,068,490.23
利率敏感度缺口	8,799,742.35	-	-	986,567,308.27	995,367,050.62

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	1,374,022,360.99	99.19	989,635,798.50	99.42
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	1,374,022,360.99	99.19	989,635,798.50	99.42

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%	68,445,522.36	48,035,676.70
	业绩比较基准下降5%	-68,445,522.36	-48,035,676.70

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	1,373,628,021.76	987,771,380.59
第二层次	15,385.54	1,676,784.50
第三层次	378,953.69	187,633.41
合计	1,374,022,360.99	989,635,798.50

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	1,374,022,360.99	97.03
	其中：股票	1,374,022,360.99	97.03
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	38,207,930.95	2.70
8	其他各项资产	3,882,673.50	0.27
9	合计	1,416,112,965.44	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	13,538,739.00	0.98
B	采矿业	68,769,018.05	4.96
C	制造业	688,550,518.59	49.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,777,459.00	3.59
E	建筑业	25,812,089.00	1.86
F	批发和零售业	3,328,316.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	48,074,531.00	3.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,877,128.15	4.68

J	金融业	369,425,182.20	26.67
K	房地产业	10,146,955.00	0.73
L	租赁和商务服务业	12,541,095.00	0.91
M	科学研究和技术服务业	14,720,550.00	1.06
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	3,837,600.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,373,399,180.99	99.15

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	604,109.50	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	623,180.00	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	41,400	58,354,128.00	4.21
2	300750	宁德时代	174,500	44,012,390.00	3.18
3	601318	中国平安	709,500	39,363,060.00	2.84
4	600036	招商银行	816,100	37,499,795.00	2.71
5	601166	兴业银行	1,096,200	25,585,308.00	1.85
6	600900	长江电力	806,800	24,316,952.00	1.76
7	000333	美的集团	324,100	23,400,020.00	1.69
8	601899	紫金矿业	1,086,000	21,177,000.00	1.53
9	002594	比亚迪	59,900	19,881,409.00	1.44
10	300059	东方财富	822,900	19,033,677.00	1.37
11	600030	中信证券	643,800	17,781,756.00	1.28
12	601398	工商银行	2,311,200	17,542,008.00	1.27
13	600276	恒瑞医药	294,600	15,289,740.00	1.10

14	000858	五 粮 液	127,800	15,195,420.00	1.10
15	601211	国泰海通	744,920	14,272,667.20	1.03
16	601328	交通银行	1,759,200	14,073,600.00	1.02
17	000651	格力电器	295,700	13,282,844.00	0.96
18	601288	农业银行	2,105,300	12,379,164.00	0.89
19	600887	伊利股份	417,200	11,631,536.00	0.84
20	002475	立讯精密	334,700	11,610,743.00	0.84
21	688981	中芯国际	131,122	11,561,026.74	0.83
22	600919	江苏银行	968,000	11,557,920.00	0.83
23	603259	药明康德	164,800	11,461,840.00	0.83
24	601816	京沪高铁	1,935,600	11,129,700.00	0.80
25	600000	浦发银行	774,200	10,745,896.00	0.78
26	000725	京东方 A	2,421,600	9,662,184.00	0.70
27	002371	北方华创	21,400	9,463,294.00	0.68
28	300760	迈瑞医疗	40,000	8,990,000.00	0.65
29	601088	中国神华	217,700	8,825,558.00	0.64
30	688041	海光信息	61,512	8,691,030.48	0.63
31	300308	中际旭创	58,900	8,591,154.00	0.62
32	601601	中国太保	225,800	8,469,758.00	0.61
33	300502	新易盛	65,620	8,335,052.40	0.60
34	688256	寒武纪	13,585	8,171,377.50	0.59
35	300124	汇川技术	124,300	8,026,051.00	0.58
36	601728	中国电信	1,024,000	7,936,000.00	0.57
37	601668	中国建筑	1,362,700	7,862,779.00	0.57
38	600016	民生银行	1,637,100	7,776,225.00	0.56
39	002352	顺丰控股	158,800	7,743,088.00	0.56
40	000001	平安银行	640,000	7,724,800.00	0.56
41	002714	牧原股份	180,300	7,574,403.00	0.55
42	002230	科大讯飞	152,500	7,301,700.00	0.53
43	601127	赛力斯	53,700	7,212,984.00	0.52
44	603501	豪威集团	55,900	7,135,635.00	0.52

45	600031	三一重工	391,100	7,020,245.00	0.51
46	601229	上海银行	655,800	6,958,038.00	0.50
47	000063	中兴通讯	212,700	6,910,623.00	0.50
48	603019	中科曙光	96,700	6,807,680.00	0.49
49	002415	海康威视	243,400	6,749,482.00	0.49
50	600309	万华化学	124,100	6,733,666.00	0.49
51	600941	中国移动	59,800	6,730,490.00	0.49
52	601169	北京银行	975,800	6,664,714.00	0.48
53	300274	阳光电源	95,500	6,472,035.00	0.47
54	601857	中国石油	747,200	6,388,560.00	0.46
55	601919	中远海控	415,900	6,255,136.00	0.45
56	688008	澜起科技	75,509	6,191,738.00	0.45
57	600690	海尔智家	247,200	6,125,616.00	0.44
58	600660	福耀玻璃	105,800	6,031,658.00	0.44
59	601688	华泰证券	337,500	6,010,875.00	0.43
60	601012	隆基绿能	399,600	6,001,992.00	0.43
61	300498	温氏股份	349,200	5,964,336.00	0.43
62	002142	宁波银行	217,300	5,945,328.00	0.43
63	600406	国电南瑞	264,900	5,936,409.00	0.43
64	600809	山西汾酒	32,300	5,697,397.00	0.41
65	601766	中国中车	802,200	5,647,488.00	0.41
66	601138	工业富联	262,000	5,601,560.00	0.40
67	603986	兆易创新	43,700	5,529,361.00	0.40
68	600050	中国联通	1,030,900	5,505,006.00	0.40
69	000338	潍柴动力	357,100	5,492,198.00	0.40
70	000568	泸州老窖	48,400	5,488,560.00	0.40
71	600028	中国石化	961,800	5,424,552.00	0.39
72	000100	TCL科技	1,238,270	5,361,709.10	0.39
73	601988	中国银行	944,200	5,306,404.00	0.38
74	601006	大秦铁路	797,300	5,262,180.00	0.38
75	688012	中微公司	28,475	5,190,992.50	0.37

76	600926	杭州银行	303,200	5,099,824.00	0.37
77	601818	光大银行	1,224,200	5,080,430.00	0.37
78	601985	中国核电	542,500	5,056,100.00	0.37
79	601225	陕西煤业	255,900	4,923,516.00	0.36
80	600104	上汽集团	305,400	4,901,670.00	0.35
81	002027	分众传媒	666,500	4,865,450.00	0.35
82	600150	中国船舶	147,500	4,799,650.00	0.35
83	601628	中国人寿	109,900	4,526,781.00	0.33
84	601009	南京银行	387,700	4,505,074.00	0.33
85	600999	招商证券	244,500	4,300,755.00	0.31
86	603288	海天味业	110,100	4,283,991.00	0.31
87	600760	中航沈飞	72,760	4,265,191.20	0.31
88	605499	东鹏饮料	13,580	4,264,799.00	0.31
89	688111	金山办公	15,073	4,221,193.65	0.30
90	000425	徐工机械	542,500	4,215,225.00	0.30
91	601939	建设银行	443,100	4,182,864.00	0.30
92	000625	长安汽车	327,593	4,180,086.68	0.30
93	000792	盐湖股份	244,100	4,169,228.00	0.30
94	600111	北方稀土	166,700	4,150,830.00	0.30
95	600938	中国海油	157,700	4,117,547.00	0.30
96	688271	联影医疗	32,184	4,111,184.16	0.30
97	600905	三峡能源	943,800	4,020,588.00	0.29
98	600436	片仔癀	20,100	4,020,201.00	0.29
99	600089	特变电工	333,400	3,977,462.00	0.29
100	601658	邮储银行	727,100	3,977,237.00	0.29
101	601888	中国中免	64,500	3,932,565.00	0.28
102	603993	洛阳钼业	463,300	3,900,986.00	0.28
103	002050	三花智控	147,800	3,898,964.00	0.28
104	300015	爱尔眼科	307,500	3,837,600.00	0.28
105	600048	保利发展	473,500	3,835,350.00	0.28
106	300033	同花顺	14,000	3,822,140.00	0.28

107	600019	宝钢股份	577,900	3,808,361.00	0.27
108	600547	山东黄金	119,100	3,802,863.00	0.27
109	601390	中国中铁	677,200	3,799,092.00	0.27
110	002463	沪电股份	88,600	3,772,588.00	0.27
111	002241	歌尔股份	161,100	3,756,852.00	0.27
112	600415	小商品城	181,000	3,743,080.00	0.27
113	300014	亿纬锂能	80,900	3,706,029.00	0.27
114	601825	沪农商行	381,600	3,701,520.00	0.27
115	601600	中国铝业	522,900	3,681,216.00	0.27
116	601989	中国重工	752,000	3,489,280.00	0.25
117	000977	浪潮信息	68,100	3,464,928.00	0.25
118	600585	海螺水泥	158,200	3,396,554.00	0.25
119	600893	航发动力	87,700	3,379,958.00	0.24
120	002179	中航光电	83,700	3,378,132.00	0.24
121	601916	浙商银行	994,600	3,371,694.00	0.24
122	601838	成都银行	167,500	3,366,750.00	0.24
123	600570	恒生电子	100,000	3,354,000.00	0.24
124	600958	东方证券	344,800	3,337,664.00	0.24
125	600015	华夏银行	419,800	3,320,618.00	0.24
126	603799	华友钴业	89,600	3,316,992.00	0.24
127	000538	云南白药	59,100	3,297,189.00	0.24
128	000776	广发证券	194,600	3,271,226.00	0.24
129	601336	新华保险	54,800	3,205,800.00	0.23
130	002311	海大集团	54,600	3,199,014.00	0.23
131	600584	长电科技	94,200	3,173,598.00	0.23
132	000938	紫光股份	131,800	3,161,882.00	0.23
133	002028	思源电气	41,000	2,989,310.00	0.22
134	600438	通威股份	178,300	2,986,525.00	0.22
135	000166	申万宏源	594,200	2,982,884.00	0.22
136	601998	中信银行	349,400	2,969,900.00	0.21
137	300408	三环集团	88,300	2,949,220.00	0.21

138	002049	紫光国微	44,700	2,943,942.00	0.21
139	300433	蓝思科技	131,200	2,925,760.00	0.21
140	601077	渝农商行	408,400	2,915,976.00	0.21
141	000002	万科A	449,000	2,882,580.00	0.21
142	600795	国电电力	587,900	2,845,436.00	0.21
143	601377	兴业证券	455,700	2,820,783.00	0.20
144	600489	中金黄金	191,800	2,806,034.00	0.20
145	601669	中国电建	568,100	2,766,647.00	0.20
146	601995	中金公司	77,100	2,726,256.00	0.20
147	601689	拓普集团	57,600	2,721,600.00	0.20
148	600010	包钢股份	1,493,300	2,673,007.00	0.19
149	002422	科伦药业	73,800	2,650,896.00	0.19
150	600009	上海机场	82,000	2,605,140.00	0.19
151	002304	洋河股份	39,700	2,562,635.00	0.18
152	601100	恒立液压	35,414	2,549,808.00	0.18
153	600160	巨化股份	88,900	2,549,652.00	0.18
154	002460	赣锋锂业	74,500	2,515,865.00	0.18
155	000768	中航西飞	91,500	2,501,610.00	0.18
156	300394	天孚通信	30,900	2,467,056.00	0.18
157	601881	中国银河	143,400	2,459,310.00	0.18
158	601186	中国铁建	303,500	2,431,035.00	0.18
159	600183	生益科技	80,100	2,415,015.00	0.17
160	002252	上海莱士	350,100	2,405,187.00	0.17
161	000157	中联重科	327,771	2,369,784.33	0.17
162	688036	传音控股	29,688	2,366,133.60	0.17
163	601360	三六零	230,800	2,354,160.00	0.17
164	000963	华东医药	58,100	2,344,916.00	0.17
165	600989	宝丰能源	145,200	2,343,528.00	0.17
166	600886	国投电力	158,300	2,333,342.00	0.17
167	002074	国轩高科	71,400	2,317,644.00	0.17
168	601788	光大证券	128,600	2,312,228.00	0.17

169	601058	赛轮轮胎	173,700	2,278,944.00	0.16
170	600115	中国东航	564,400	2,274,532.00	0.16
171	300442	润泽科技	45,300	2,243,709.00	0.16
172	000408	藏格矿业	51,600	2,201,772.00	0.16
173	000807	云铝股份	137,400	2,195,652.00	0.16
174	002736	国信证券	190,200	2,191,104.00	0.16
175	002466	天齐锂业	68,300	2,188,332.00	0.16
176	600066	宇通客车	87,500	2,175,250.00	0.16
177	002001	新 和 成	101,500	2,158,905.00	0.16
178	000661	长春高新	21,700	2,152,206.00	0.16
179	601901	方正证券	271,400	2,146,774.00	0.15
180	600426	华鲁恒升	98,200	2,127,994.00	0.15
181	688169	石头科技	13,473	2,109,198.15	0.15
182	600196	复星医药	83,700	2,100,033.00	0.15
183	600029	南方航空	355,400	2,096,860.00	0.15
184	001979	招商蛇口	238,900	2,095,153.00	0.15
185	300661	圣邦股份	28,670	2,086,315.90	0.15
186	601800	中国交建	234,600	2,085,594.00	0.15
187	000975	山金国际	109,900	2,081,506.00	0.15
188	600011	华能国际	290,300	2,072,742.00	0.15
189	002236	大华股份	130,300	2,069,164.00	0.15
190	301236	软通动力	37,700	2,059,928.00	0.15
191	600674	川投能源	128,400	2,059,536.00	0.15
192	601066	中信建投	85,600	2,058,680.00	0.15
193	688126	沪硅产业	108,695	2,034,770.40	0.15
194	600346	恒力石化	139,400	1,987,844.00	0.14
195	601878	浙商证券	181,100	1,975,801.00	0.14
196	300418	昆仑万维	58,200	1,957,266.00	0.14
197	601111	中国国航	246,900	1,948,041.00	0.14
198	600372	中航机载	159,500	1,923,570.00	0.14
199	002648	卫星化学	110,800	1,920,164.00	0.14

200	603369	今世缘	49,200	1,915,356.00	0.14
201	601868	中国能建	855,200	1,907,096.00	0.14
202	600460	士兰微	76,800	1,906,176.00	0.14
203	003816	中国广核	518,500	1,887,340.00	0.14
204	002916	深南电路	17,320	1,867,269.20	0.13
205	601117	中国化学	241,600	1,853,072.00	0.13
206	002920	德赛西威	18,100	1,848,553.00	0.13
207	600741	华域汽车	104,100	1,837,365.00	0.13
208	601319	中国人保	210,400	1,832,584.00	0.13
209	300347	泰格医药	34,100	1,818,212.00	0.13
210	600588	用友网络	135,400	1,810,298.00	0.13
211	600176	中国巨石	158,300	1,804,620.00	0.13
212	601021	春秋航空	32,300	1,797,495.00	0.13
213	002601	龙佰集团	110,200	1,786,342.00	0.13
214	300782	卓胜微	24,900	1,777,113.00	0.13
215	000786	北新建材	67,000	1,774,160.00	0.13
216	601633	长城汽车	82,200	1,765,656.00	0.13
217	600219	南山铝业	459,500	1,759,885.00	0.13
218	301269	华大九天	14,100	1,746,708.00	0.13
219	302132	中航成飞	19,700	1,732,418.00	0.13
220	600482	中国动力	74,300	1,714,101.00	0.12
221	300896	爱美客	9,800	1,713,138.00	0.12
222	600039	四川路桥	172,100	1,703,790.00	0.12
223	000630	铜陵有色	506,100	1,690,374.00	0.12
224	000895	双汇发展	68,600	1,674,526.00	0.12
225	002493	荣盛石化	200,200	1,657,656.00	0.12
226	002129	TCL中环	213,500	1,639,680.00	0.12
227	600600	青岛啤酒	23,600	1,639,256.00	0.12
228	603296	华勤技术	20,300	1,637,804.00	0.12
229	688396	华润微	34,561	1,629,896.76	0.12
230	600085	同仁堂	45,100	1,626,306.00	0.12

231	001965	招商公路	135,200	1,622,400.00	0.12
232	601877	正泰电器	70,900	1,607,303.00	0.12
233	600362	江西铜业	68,500	1,604,955.00	0.12
234	002709	天赐材料	88,200	1,598,184.00	0.12
235	002600	领益智造	185,000	1,589,150.00	0.11
236	688506	百利天恒	5,220	1,545,746.40	0.11
237	300122	智飞生物	78,900	1,545,651.00	0.11
238	603392	万泰生物	25,200	1,537,200.00	0.11
239	002180	纳思达	65,800	1,509,452.00	0.11
240	600161	天坛生物	78,200	1,500,658.00	0.11
241	300832	新产业	26,080	1,479,257.60	0.11
242	002938	鹏鼎控股	45,800	1,466,974.00	0.11
243	600233	圆通速递	113,700	1,465,593.00	0.11
244	000301	东方盛虹	174,600	1,454,418.00	0.10
245	300759	康龙化成	58,700	1,440,498.00	0.10
246	600188	兖矿能源	117,865	1,434,417.05	0.10
247	000596	古井贡酒	10,600	1,411,390.00	0.10
248	600023	浙能电力	265,300	1,406,090.00	0.10
249	601618	中国中冶	470,800	1,402,984.00	0.10
250	000876	新希望	149,300	1,400,434.00	0.10
251	688047	龙芯中科	10,440	1,392,591.60	0.10
252	000999	华润三九	43,970	1,375,381.60	0.10
253	688223	晶科能源	263,925	1,369,770.75	0.10
254	600875	东方电气	80,400	1,345,896.00	0.10
255	600845	宝信软件	56,700	1,339,254.00	0.10
256	601872	招商轮船	213,200	1,334,632.00	0.10
257	600515	海南机场	376,800	1,333,872.00	0.10
258	600027	华电国际	242,200	1,324,834.00	0.10
259	601898	中煤能源	120,600	1,319,364.00	0.10
260	002459	晶澳科技	130,700	1,304,386.00	0.09
261	605117	德业股份	24,093	1,268,737.38	0.09

262	600061	国投资本	168,500	1,267,120.00	0.09
263	688599	天合光能	86,236	1,253,009.08	0.09
264	600332	白云山	46,300	1,220,468.00	0.09
265	000617	中油资本	166,600	1,216,180.00	0.09
266	000983	山西焦煤	187,200	1,198,080.00	0.09
267	600918	中泰证券	183,900	1,182,477.00	0.09
268	300316	晶盛机电	43,100	1,170,165.00	0.08
269	601799	星宇股份	9,300	1,162,500.00	0.08
270	600803	新奥股份	61,500	1,162,350.00	0.08
271	300628	亿联网络	33,400	1,160,984.00	0.08
272	300999	金龙鱼	39,300	1,160,529.00	0.08
273	601698	中国卫通	55,500	1,136,085.00	0.08
274	600025	华能水电	118,700	1,133,585.00	0.08
275	603260	合盛硅业	23,600	1,118,640.00	0.08
276	601059	信达证券	64,300	1,099,530.00	0.08
277	601238	广汽集团	146,200	1,095,038.00	0.08
278	300413	芒果超媒	49,200	1,073,544.00	0.08
279	600018	上港集团	184,300	1,052,353.00	0.08
280	601607	上海医药	55,000	983,400.00	0.07
281	600026	中远海能	91,500	945,195.00	0.07
282	688303	大全能源	42,886	914,329.52	0.07
283	603806	福斯特	68,900	892,944.00	0.06
284	688472	阿特斯	97,294	890,240.10	0.06
285	688009	中国通号	170,555	876,652.70	0.06
286	603195	公牛集团	17,660	852,095.00	0.06
287	601699	潞安环能	78,900	832,395.00	0.06
288	601236	红塔证券	93,100	788,557.00	0.06
289	000708	中信特钢	66,700	784,392.00	0.06
290	601865	福莱特	50,000	760,500.00	0.05
291	688187	时代电气	16,966	723,599.90	0.05
292	601136	首创证券	36,100	717,668.00	0.05

293	603833	欧派家居	11,900	671,755.00	0.05
294	688082	盛美上海	5,744	654,471.36	0.05
295	601808	中海油服	39,000	536,640.00	0.04
296	300979	华利集团	9,900	520,443.00	0.04
297	600377	宁沪高速	32,800	503,152.00	0.04
298	000800	一汽解放	65,100	446,586.00	0.03
299	001289	龙源电力	9,800	158,564.00	0.01
300	001391	国货航	5,800	39,034.00	0.00

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	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
4	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
5	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.00
6	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
7	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
8	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
9	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
10	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
11	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
12	301479	弘景光电	182	14,172.34	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	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
19	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
20	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
21	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
22	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
23	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
24	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
25	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
26	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
27	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
28	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
29	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
30	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	34,594,704.59	3.48
2	601318	中国平安	22,761,872.90	2.29
3	600036	招商银行	21,638,545.00	2.17
4	601166	兴业银行	16,401,139.00	1.65
5	600900	长江电力	14,267,413.00	1.43
6	601211	国泰海通	13,509,140.16	1.36
7	601899	紫金矿业	11,662,914.00	1.17
8	600030	中信证券	10,560,803.00	1.06
9	601398	工商银行	9,976,589.00	1.00
10	600276	恒瑞医药	9,148,664.40	0.92
11	601328	交通银行	8,968,419.00	0.90

12	601288	农业银行	7,092,458.00	0.71
13	600887	伊利股份	7,056,563.00	0.71
14	688041	海光信息	6,927,064.31	0.70
15	688981	中芯国际	6,882,788.25	0.69
16	601816	京沪高铁	6,634,044.00	0.67
17	600919	江苏银行	6,371,243.00	0.64
18	300059	东方财富	6,196,638.00	0.62
19	603259	药明康德	5,999,245.00	0.60
20	600000	浦发银行	5,596,498.20	0.56

注：1、本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

2、国泰海通证券股份有限公司（简称“国泰海通”）是由国泰君安证券股份有限公司（简称“国泰君安”）与海通证券股份有限公司（简称“海通证券”）于2025年3月14日合并组建而成。本项及下项7.4.2中显示的国泰海通数据为自2025年1月1日至2025年3月13日国泰君安的交易情况及自2025年3月14日至2025年6月30日国泰海通的交易情况。上述合并导致海通证券减少以及国泰海通（原国泰君安）增加的情况已计入本项及下项7.4.2及7.4.3买入卖出的相关统计中。

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	19,436,042.82	1.95
2	601318	中国平安	11,775,137.00	1.18
3	600036	招商银行	11,342,775.00	1.14
4	600900	长江电力	7,436,330.00	0.75
5	601166	兴业银行	6,957,036.00	0.70
6	601899	紫金矿业	6,083,628.00	0.61
7	600030	中信证券	5,780,034.00	0.58
8	600837	海通证券	5,618,489.16	0.56
9	601398	工商银行	5,165,518.00	0.52
10	600276	恒瑞医药	5,032,076.80	0.51

11	688041	海光信息	4,534,776.86	0.46
12	601988	中国银行	4,440,678.00	0.45
13	600436	片仔癀	4,012,357.00	0.40
14	600887	伊利股份	3,979,936.00	0.40
15	688981	中芯国际	3,899,176.39	0.39
16	601328	交通银行	3,745,303.00	0.38
17	601211	国泰海通	3,700,900.90	0.37
18	601288	农业银行	3,623,714.00	0.36
19	601816	京沪高铁	3,568,599.00	0.36
20	600941	中国移动	3,455,152.00	0.35

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	603,427,984.57
卖出股票收入（成交）总额	339,099,478.45

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。

本基金为指数型基金，采取完全复制策略，跟踪的标的指数为沪深300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	3,882,673.50
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	3,882,673.50

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	71,143.68	0.01	新股限售
2	688411	海博思创	46,754.40	0.00	新股限售
3	301458	钧崑电子	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)	户均持有的基 金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		西藏东财沪深3 00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
18,023	64,406.65	835,411,710.00	71.97%	325,389,299.00	28.03%	58,264,540.00	5.02%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“西藏东财沪深300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	716,263,061.00	61.70%
2	创金合信基金－华夏银行－创金合信华睿8号集合资产管理计划	36,000,000.00	3.10%
3	中信证券股份有限公司	14,494,695.00	1.25%
4	UBS AG	3,238,300.00	0.28%
5	詹晓莺	2,960,000.00	0.25%
6	朱宝亭	2,772,100.00	0.24%
7	范建江	2,548,000.00	0.22%
8	严杰	2,449,900.00	0.21%
9	陈本富	2,348,700.00	0.20%
10	洪峰	2,150,000.00	0.19%
11	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	58,264,540.00	5.02%

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	0

门负责人持有本开放式基金	
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08月01日)基金份额总额	248,801,009.00
本报告期期初基金份额总额	845,801,009.00
本报告期基金总申购份额	678,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	363,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,160,801,009.00

§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	929,972,803.18	100.00%	181,471.04	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	西藏东财沪深300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	西藏东财沪深300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	西藏东财沪深300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	西藏东财沪深300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	西藏东财沪深300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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额 份额占比

类别		20%的时间区间					
机构	1	2025-01-01至2025-06-30	225,000,000.00	717,769,613.00	226,506,552.00	716,263,061.00	61.70%
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沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- 二、《西藏东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 三、《西藏东财沪深300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