

西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:华泰证券股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 27 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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2021年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至2021年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金	
基金简称	东财消费精选混合	
基金主代码	010151	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年09月23日	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	93,732,724.04份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财消费精选混合A	东财消费精选混合C
下属分级基金的交易代码	010151	010152
报告期末下属分级基金的份额总额	58,031,316.05份	35,701,407.99份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于消费主题相关的证券，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	在大类资产配置方面，本基金通过定量分析和定性分析相结合的方法，综合分析宏观经济面、政策面、市场面等多种因素，确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的配置比例。 在股票投资方面，本基金在对消费主题界定的基础上，采用定性分析和定量分析相结合的方式精选包括消费主题下的优质个股进行重点投资。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	沙福贵	李欣然
	联系电话	021-23526999	025-83388339
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	lixinran@htsc.com
客户服务电话		400-9210-107	95597
传真		021-23526940	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路228号
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码		200030	210009
法定代表人		戴彦	张伟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	东财消费精选混合A	东财消费精选混合C
本期已实现收益	12,604,721.04	8,372,718.89
本期利润	2,296,012.32	1,538,149.83
加权平均基金份额本期利润	0.0340	0.0347
本期加权平均净值利润率	2.93%	3.00%
本期基金份额净值增长率	2.69%	2.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	东财消费精选混合A	东财消费精选混合C
期末可供分配利润	9,967,119.09	5,875,384.54
期末可供分配基金份额利润	0.1718	0.1646
期末基金资产净值	67,998,435.14	41,576,792.53
期末基金份额净值	1.1718	1.1646
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	东财消费精选混合A	东财消费精选混合C
基金份额累计净值增长率	17.18%	16.46%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东财消费精选混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-3.72%	0.89%	-3.86%	0.76%	0.14%	0.13%
过去三个月	6.81%	1.23%	1.74%	1.06%	5.07%	0.17%
过去六个月	2.69%	1.76%	-2.68%	1.48%	5.37%	0.28%
自基金合同 生效起至今	17.18%	1.48%	17.06%	1.33%	0.12%	0.15%

东财消费精选混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-3.78%	0.89%	-3.86%	0.76%	0.08%	0.13%
过去三个月	6.60%	1.23%	1.74%	1.06%	4.86%	0.17%
过去六个月	2.28%	1.76%	-2.68%	1.48%	4.96%	0.28%
自基金合同 生效起至今	16.46%	1.48%	17.06%	1.33%	-0.60%	0.15%

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

东财消费精选混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年09月23日-2021年06月30日)



东财消费精选混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年09月23日-2021年06月30日)



注：1、本基金基金合同于 2020 年 9 月 23 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2021年6月30日，公司旗下管理13只证券投资基金—西藏东财上证50指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财信息产业精选混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金。

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、西藏东财上证50指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证医药卫生指	2020-09-23	-	11年	上海财经大学经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。自2010年6月开始，先后在天治基金管理有限公司、东方财富信息股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、西藏东财基金管理有限公司筹备组、西藏东财基金

	数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财信息产业精选混合型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金的基金经理、量化投资部总监、研究部总监				管理有限公司担任产品创新及量化投资部总监助理、筹备组成员、资产管理总部投资主办人、量化投资部总监、研究部总监等职务。
姚楠燕	本基金基金经理助理、西藏东财创业板指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金的基金经理、西藏东财上证50指数型发起式证券投资基金的基金经	2020-11-04	-	4年	复旦大学经济学学士学位，美国南加利福尼亚大学公共政策硕士学位。自2013年8月始，先后在中欧国际工商学院、西藏东财基金管理有限公司筹备组、西藏东财基金管理有限公司担任金融学/会计学研究助理、筹备组成员、投资助理、基金经理助理兼研究员等职务。

	理助理、西藏东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财量化精选混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、西藏东财信息产业精选混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、研究员				
--	---	--	--	--	--

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》等相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A股市场震荡上行，虽然一季度中国股市受政策层面影响下挫明显，但就整个上半年来看，股市表现仍然较为亮眼，上证综指上扬3.40%、创业板指数与科创50指数分别上扬17.22%和14.01%。

在这种市场环境下，东财消费精选混合坚持了基本面+量化的投资策略，同时在风格上偏向于大消费板块中的盈利与估值相匹配的细分行业和公司，以追求更加稳健的业绩表现。

2021年是“十四五”规划开局之年，消费升级和需求侧改革，将为“双循环”打下良好基础，伴随中国经济向高质量的经济结构转型，东财消费精选混合将力争为投资者获取良好的长期回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年6月30日，东财消费精选混合A份额净值为1.1718元，报告期内基金份额净值增长率为2.69%，东财消费精选混合C份额净值为1.1646元，报告期内基金份额净值增长率为2.28%，同期业绩比较基准收益率为-2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，2021年上半年我国经济持续修复，经济运行总体稳中向好，上半年GDP同比增长12.7%。由于过去一年低基数效应的逐步消失，经济同比增速逐渐开始反映经济真实的增长动能和趋势。往后看，从国内驱动经济增长的变量来看，前期高景气强韧性的经济主要驱动力量如出口、房地产投资，在下半年可能会逐步回落，而消费、制造业投资等过去一年修复疲弱的变量，从两年平均增速来看，仍存在继续上行的空间。此外，需关注美联储货币政策外溢影响、中美关系、大宗商品价格传导效应等带来的波动影响。

政策方面，鉴于国内外经济运行依然存在不确定性和不稳定性，预计下半年积极财政政策实施力度将有所加大；货币政策延续“稳”字当头，同时继续保持灵活精准。此

外，关注包括深入推进科技自立自强战略、持续推进“双碳”战略、应对人口老龄化挑战、治理地方政府隐性债务等相关政策的推进。

市场方面，尽管一季度股市动荡不已，但二季度创业板行情重新开启，在新一轮资本市场改革和提高直接融资占比的战略导向下，看好创新成长。股票方面，盈利增速可能已过高点，流动性环境继续推升估值空间较小，下半年A股整体或维持震荡态势，但结构上不乏亮点，高景气的成长板块、核心资产、以及成长方向具有长期性的行业可能占优。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，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

本基金本报告期末未发生相关预警情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司及时完成了基金名下的资金划拨，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，并严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、费用开支方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金2021年半年报中的有关财务数据、净值表现、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	12,727,469.69	23,012,625.62
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	98,534,447.00	131,917,310.72
其中：股票投资		98,534,447.00	131,917,310.72
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,539.50	11,338.96
应收股利		-	-

应收申购款		29,223.62	1,689,909.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		111,294,679.81	156,631,184.75
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,427,560.70	1,002,483.06
应付管理人报酬		142,836.75	160,332.30
应付托管费		9,522.44	10,688.81
应付销售服务费		28,657.30	36,461.03
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	110,874.95	49,733.12
负债合计		1,719,452.14	1,259,698.32
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	93,732,724.04	136,285,441.44
未分配利润	6.4.7.10	15,842,503.63	19,086,044.99
所有者权益合计		109,575,227.67	155,371,486.43
负债和所有者权益总计		111,294,679.81	156,631,184.75

注：报告截止日2021年6月30日，东财消费精选混合A基金份额净值1.1718元，基金份额总额58,031,316.05份；东财消费精选混合C基金份额净值1.1646元，基金份额总额35,701,407.99份。基金份额总额合计为93,732,724.04份。

6.2 利润表

会计主体：西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年0 6月30日
一、收入		5,681,161.92
1. 利息收入		72,897.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	72,897.18
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		—
证券出借利息收入		—
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,410,841.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,922,059.81
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.3	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—
股利收益	6.4.7.16	488,781.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-17,143,277.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	340,701.23
减：二、费用		1,846,999.77

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	972,781.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,852.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	205,237.75
4. 交易费用	6.4.7.19	532,720.11
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	71,408.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,834,162.15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,834,162.15

注：本基金基金合同生效日为2020年9月23日，本期是指2021年1月1日至2021年6月30日，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	136,285,441.44	19,086,044.99	155,371,486.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,834,162.15	3,834,162.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-42,552,717.40	-7,077,703.51	-49,630,420.91
其中：1. 基金申购款	65,703,373.40	11,903,722.71	77,607,096.11

2. 基金赎回款	-108,256,090.80	-18,981,426.22	-127,237,517.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	93,732,724.04	15,842,503.63	109,575,227.67

注：本基金基金合同生效日为2020年9月23日，本期是指2021年1月1日至2021年6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

西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人西藏东财基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]1944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133,847,353.07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（20）第00011号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2020年9月23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，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

根据《西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基

金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资业务。本基金股票资产投资比例为基金资产的60%-95%，其中，投资于消费主题相关的证券资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证内地消费主题指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号<半年度报告的内容与格式>》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及2021年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本基金财务报表的实际编制期间为2021年1月1日至2021年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金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贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，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根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

（1）对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

（2）对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

（3）对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（4）当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）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。

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。

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在转融通证券实际出借期间内，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时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的差额确认。

债券投资收益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与应收利息（若有）后的差额确认。

资产支持证券投资收益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与应收利息（若有）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后的差额确认。

股利收入于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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率逐日计提。

东财消费精选混合A基金份额不收取销售服务费；东财消费精选混合C基金份额的销售服务费按前一日该类别基金资产净值的0.80%年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）

本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

（2）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（3）根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	2,861,284.98
定期存款	—
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	9,866,184.71
合计	12,727,469.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		102,328,970.01	98,534,447.00	-3,794,523.01
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		102,328,970.01	98,534,447.00	-3,794,523.01

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,341.78
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2,197.72
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	3,539.50

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,666.83
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	11,900.75
预提费用-信息披露费	89,507.37
其他应付	6,800.00
合计	110,874.95

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 东财消费精选混合A

金额单位：人民币元

项目 (东财消费精选混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	79,576,085.71	79,576,085.71
本期申购	31,825,730.23	31,825,730.23
本期赎回（以“-”号填列）	-53,370,499.89	-53,370,499.89
本期末	58,031,316.05	58,031,316.05

6.4.7.9.2 东财消费精选混合C

金额单位：人民币元

项目 (东财消费精选混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,709,355.73	56,709,355.73
本期申购	33,877,643.17	33,877,643.17
本期赎回（以“-”号填列）	-54,885,590.91	-54,885,590.91
本期末	35,701,407.99	35,701,407.99

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 东财消费精选混合A

单位：人民币元

项目 (东财消费精选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,446,421.77	8,779,358.84	11,225,780.61
本期利润	12,604,721.04	-10,308,708.72	2,296,012.32
本期基金份额交易产生的变动数	-3,154,067.03	-400,606.81	-3,554,673.84

其中：基金申购款	3,635,278.57	2,235,588.96	5,870,867.53
基金赎回款	-6,789,345.60	-2,636,195.77	-9,425,541.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,897,075.78	-1,929,956.69	9,967,119.09

6.4.7.10.2 东财消费精选混合C

单位：人民币元

项目 (东财消费精选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,615,587.44	6,244,676.94	7,860,264.38
本期利润	8,372,718.89	-6,834,569.06	1,538,149.83
本期基金份额交易产生的变动数	-2,935,704.29	-587,325.38	-3,523,029.67
其中：基金申购款	3,757,658.79	2,275,196.39	6,032,855.18
基金赎回款	-6,693,363.08	-2,862,521.77	-9,555,884.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,052,602.04	-1,177,217.50	5,875,384.54

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	39,839.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	33,057.32
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	72,897.18

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	270,157,609.03
减：卖出股票成本总额	248,235,549.22
买卖股票差价收入	21,922,059.81

6.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	488,781.48
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	488,781.48

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-17,143,277.78
——股票投资	-17,143,277.78
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-17,143,277.78

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	330,806.15
转换费收入	9,895.08
合计	340,701.23

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	532,720.11

银行间市场交易费用	-
合计	532,720.11

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	0.00
合计	71,408.12

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金基金管理人母公司的控股股东东方财富信息股份有限公司（以下简称“东方财富”）控制的子公司东方财富（香港）有限公司于2021年4月设立三家子公司，分别为哈富证券有限公司、哈富期货有限公司和哈富网络科技有限公司，东方财富的子公司上海东方财富金融数据服务有限公司于2021年4月设立了扬州东方财富数据服务有限公司，东方财富于2021年5月设立了上海哈富网络科技有限公司。

2021年5月，东方财富国际证券有限公司更名为哈富证券有限公司，东方财富国际期货有限公司更名为哈富期货有限公司；哈富证券有限公司更名为东方财富国际证券有限公司，哈富期货有限公司更名为东方财富国际期货有限公司。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

西藏东财基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商
上海天天基金销售有限公司（“天天基金”）	与管理人受同一实际控制人控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021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	499,854,647.82	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 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
东财证券	211,932.12	100.00%	-	-

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	972,781.71
其中：支付销售机构的客户维护费	440,569.90

注：本基金的管理费按前一日资产净值的1.50%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：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	64,852.08

注：本基金的托管费按前一日资产净值的0.10%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财消费精选混合A	东财消费精选混合C	合计
东方财富 证券股份 有限公司	0.00	50,453.78	50,453.78
上海天天 基金销售 有限公司	0.00	152,294.83	152,294.83
合计	0.00	202,748.61	202,748.61

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

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

东财消费精选混合A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金合同生效日（2020年09月23日）持有的基金份额	10,000,450.05
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,450.05
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.23%

东财消费精选混合C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金合同生效日（2020年09月23日）持有的基金份额	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

注：1、本基金基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、本基金基金合同于2020年9月23日生效，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

本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券-托管户	2,861,284.98	39,839.86
东财证券-证券资金户	9,866,184.71	33,057.32

注：1、本基金的银行存款存放在托管人华泰证券在中国工商银行股份有限公司开立的托管账户中，本基金本报告期内无源自本基金托管人华泰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

本基金报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金报告期未发生其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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	可流通日	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
688323	瑞华泰	2021-04-	2021-10-	科创板新	5.97	22.78	4,513	26,942.6	102,806.	-

		21	28	股限售				1	14	
688217	睿昂基因	2021-05-07	2021-11-17	科创板新股限售	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	科创板新股限售	14.48	19.21	2,206	31,942.88	42,377.26	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	创业板新股限售	28.77	99.85	141	4,056.57	14,078.85	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	创业板新股限售	16.53	46.07	209	3,454.77	9,628.63	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	创业板新股限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	创业板新股限售	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板新股限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
3009	英力	2021	2021	创业	12.8	25.8	323	4,15	8,33	-

56	股份	-03- 16	-09- 27	板新 股限 售	5	0		0.55	3.40	
----	----	------------	------------	---------------	---	---	--	------	------	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券余额。

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

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券等。本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

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

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,727,469.69	-	-	-	12,727,469.69
交易性 金融资 产	-	-	-	98,534,447.00	98,534,447.00
应收利 息	-	-	-	3,539.50	3,539.50
应收申 购款	-	-	-	29,223.62	29,223.62

西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金 2021 年中期报告

资产总计	12,727,469.69	-	-	98,567,210.12	111,294,679.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,427,560.70	1,427,560.70
应付管理人报酬	-	-	-	142,836.75	142,836.75
应付托管费	-	-	-	9,522.44	9,522.44
应付销售服务费	-	-	-	28,657.30	28,657.30
其他负债	-	-	-	110,874.95	110,874.95
负债总计	-	-	-	1,719,452.14	1,719,452.14
利率敏感度缺口	12,727,469.69	-	-	96,847,757.98	109,575,227.67
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,012,625.62	-	-	-	23,012,625.62
交易性金融资产	-	-	-	131,917,310.72	131,917,310.72
应收利息	-	-	-	11,338.96	11,338.96
应收申购款	-	-	-	1,689,909.45	1,689,909.45
资产总计	23,012,625.62	-	-	133,618,559.13	156,631,184.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,002,483.06	1,002,483.06
应付管理人报酬	-	-	-	160,332.30	160,332.30
应付托管费	-	-	-	10,688.81	10,688.81
应付销	-	-	-	36,461.03	36,461.03

售服务费					
其他负债	-	-	-	49,733.12	49,733.12
负债总计	-	-	-	1,259,698.32	1,259,698.32
利率敏感度缺口	23,012,625.62	-	-	132,358,860.81	155,371,486.43

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021年06月30日		2020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	98,534,447.00	89.92	131,917,310.72	84.90
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	98,534,447.00	89.92	131,917,310.72	84.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	6,000,512.30	2,942,638.76
	业绩比较基准下降5%	-6,000,512.30	-2,942,638.76

6.4.14 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	98,534,447.00	88.53
	其中：股票	98,534,447.00	88.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,727,469.69	11.44
8	其他各项资产	32,763.12	0.03
9	合计	111,294,679.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	84,467,583.86	77.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	387,349.12	0.35
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	12,230.40	0.01
J	金融业	34,721.10	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,660,158.00	8.82
M	科学研究和技术服务业	1,915,495.00	1.75
N	水利、环境和公共设施管理业	8,884.08	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,032,349.00	1.85
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	98,534,447.00	89.92

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601888	中国中免	31,200	9,363,120.00	8.54
2	000858	五 粮 液	31,300	9,323,957.00	8.51
3	603288	海天味业	69,750	8,994,262.50	8.21
4	600276	恒瑞医药	130,580	8,875,522.60	8.10
5	000333	美的集团	115,000	8,207,550.00	7.49
6	002304	洋河股份	34,500	7,148,400.00	6.52
7	300122	智飞生物	25,800	4,817,634.00	4.40
8	000661	长春高新	10,640	4,117,680.00	3.76
9	002821	凯莱英	8,200	3,055,320.00	2.79
10	000596	古井贡酒	10,650	2,550,675.00	2.33

11	603899	晨光文具	25,959	2,195,093.04	2.00
12	002050	三花智控	88,700	2,127,026.00	1.94
13	603369	今世缘	33,900	1,836,024.00	1.68
14	603833	欧派家居	11,800	1,675,128.00	1.53
15	002007	华兰生物	42,300	1,551,564.00	1.42
16	603882	金城医学	9,700	1,549,769.00	1.41
17	603658	安图生物	20,110	1,523,734.70	1.39
18	300529	健帆生物	14,600	1,260,856.00	1.15
19	603816	顾家家居	16,200	1,251,936.00	1.14
20	603345	安井食品	4,600	1,168,492.00	1.07
21	603127	昭衍新药	6,100	1,120,875.00	1.02
22	002508	老板电器	24,000	1,116,000.00	1.02
23	600161	天坛生物	32,100	1,099,425.00	1.00
24	002032	苏泊尔	16,500	1,052,535.00	0.96
25	600872	中炬高新	22,200	932,844.00	0.85
26	603198	迎驾贡酒	19,700	872,710.00	0.80
27	300677	英科医疗	6,500	811,200.00	0.74
28	300676	华大基因	6,700	794,620.00	0.73
29	002867	周大生	31,950	631,651.50	0.58
30	300482	万孚生物	9,600	621,024.00	0.57
31	002901	大博医疗	8,500	619,565.00	0.57
32	300685	艾德生物	5,400	562,032.00	0.51
33	600529	山东药玻	16,200	549,990.00	0.50
34	600612	老凤祥	9,200	487,324.00	0.44
35	688139	海尔生物	4,595	482,934.50	0.44
36	300244	迪安诊断	12,600	482,580.00	0.44
37	002572	索菲亚	16,700	404,140.00	0.37
38	603195	公牛集团	2,000	404,000.00	0.37
39	002831	裕同科技	13,300	394,877.00	0.36
40	000028	国药一致	10,000	378,400.00	0.35
41	002262	恩华药业	22,631	347,385.85	0.32

42	000921	海信家电	23,300	334,821.00	0.31
43	603043	广州酒家	12,180	313,269.60	0.29
44	300662	科锐国际	4,900	297,038.00	0.27
45	002677	浙江美大	10,800	197,424.00	0.18
46	300206	理邦仪器	9,300	147,870.00	0.13
47	603317	天味食品	4,880	143,618.40	0.13
48	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.09
49	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.06
50	688663	新风光	2,206	42,377.26	0.04
51	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
52	300953	震裕科技	141	14,078.85	0.01
53	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
54	603171	N税友	637	12,230.40	0.01
55	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
56	300955	嘉亨家化	209	9,628.63	0.01
57	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
58	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
59	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
60	300956	英力股份	323	8,333.40	0.01
61	605011	N杭热	525	4,662.00	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	000333	美的集团	25,973,441.07	16.72
2	600276	恒瑞医药	17,287,080.23	11.13
3	601888	中国中免	17,241,723.85	11.10
4	603288	海天味业	17,129,702.20	11.02
5	002304	洋河股份	16,612,985.98	10.69

6	000661	长春高新	15,358,800.80	9.89
7	000858	五 粮 液	12,505,763.00	8.05
8	600809	山西汾酒	12,269,184.00	7.90
9	300122	智飞生物	10,279,017.20	6.62
10	000596	古井贡酒	8,468,531.00	5.45
11	603899	晨光文具	4,544,446.86	2.92
12	600690	海尔智家	4,235,223.00	2.73
13	600132	重庆啤酒	3,927,597.74	2.53
14	603369	今世缘	3,181,173.00	2.05
15	002727	一心堂	3,015,417.00	1.94
16	600600	青岛啤酒	2,957,604.00	1.90
17	603882	金域医学	2,707,213.00	1.74
18	002050	三花智控	2,533,115.00	1.63
19	603866	桃李面包	2,508,249.15	1.61
20	603833	欧派家居	2,241,607.00	1.44

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	600809	山西汾酒	24,510,269.44	15.78
2	601888	中国中免	17,925,069.80	11.54
3	000333	美的集团	16,069,340.78	10.34
4	600519	贵州茅台	15,184,922.96	9.77
5	600436	片仔癀	14,229,502.80	9.16
6	300122	智飞生物	12,487,978.26	8.04
7	000661	长春高新	11,249,746.00	7.24
8	002304	洋河股份	7,886,254.00	5.08
9	603899	晨光文具	7,035,883.00	4.53
10	000596	古井贡酒	6,574,804.00	4.23

11	000538	云南白药	6,342,297.00	4.08
12	603288	海天味业	5,989,039.60	3.85
13	600276	恒瑞医药	5,857,023.00	3.77
14	603833	欧派家居	5,513,100.00	3.55
15	300601	康泰生物	5,447,708.00	3.51
16	300347	泰格医药	5,155,852.52	3.32
17	002050	三花智控	5,060,086.48	3.26
18	600132	重庆啤酒	4,727,050.30	3.04
19	603882	金域医学	4,573,808.00	2.94
20	000858	五 粮 液	4,050,425.00	2.61
21	000895	双汇发展	3,949,772.00	2.54
22	600690	海尔智家	3,880,913.00	2.50
23	002007	华兰生物	3,343,648.50	2.15

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	231,995,963.28
卖出股票收入（成交）总额	270,157,609.03

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	3,539.50
5	应收申购款	29,223.62
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	32,763.12

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

本基金本报告期末投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
东财 消费 精选 混合A	3,115	18,629.64	10,499,850.77	18.09%	47,531,465.28	81.91%
东财 消费 精选 混合C	2,571	13,886.20	300,067.50	0.84%	35,401,340.49	99.16%
合计	5,456	17,179.75	10,799,918.27	11.52%	82,932,805.77	88.48%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东财消费精选混合A	16.91	0.00%
	东财消费精选混合C	—	—

	合计	16.91	0.00%
--	----	-------	-------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东财消费精选混合 A	0
	东财消费精选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东财消费精选混合 A	0
	东财消费精选混合 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.05	10.67%	10,000,450.05	10.67%	不少于三年
基金管理人高级管理人	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—

员					
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
合计	10,000,450.05	10.67%	10,000,450.05	10.67%	—

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东财消费精选混合A	东财消费精选混合C
基金合同生效日(2020年09月23日)基金份额总额	69,603,213.69	64,244,139.38
本报告期期初基金份额总额	79,576,085.71	56,709,355.73
本报告期基金总申购份额	31,825,730.23	33,877,643.17
减：本报告期基金总赎回份额	53,370,499.89	54,885,590.91
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	58,031,316.05	35,701,407.99

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：自2021年3月23日起，沙福贵先生担任公司副总经理职务；自2021年4月30日起，荀航先生担任公司副总经理职务。

基金托管人：本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略未发生重大变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金基金管理人及其高级管理人员、基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东财证券	2	499,854,647.82	100.00%	211,932.12	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金2020年第4季度报告	证监会规定网站	2021-01-21
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	证监会规定报刊及网站	2021-01-29

	等级评价结果的公告		
3	西藏东财基金管理有限公司关于提示投资者持续完善客户身份信息的公告	证监会规定报刊及网站	2021-01-30
4	西藏东财基金管理有限公司关于公司住所变更公告	证监会规定报刊及网站	2021-03-03
5	西藏东财基金管理有限公司高级管理人员任职公告	证监会规定报刊及网站	2021-03-23
6	西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金2020年年度报告	证监会规定网站	2021-03-30
7	西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金2021年第1季度报告	证监会规定网站	2021-04-21
8	西藏东财基金管理有限公司高级管理人员任职公告	证监会规定报刊及网站	2021-05-01
9	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与招商证券股份有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定报刊及网站	2021-06-19
10	西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金招募说明书更新(2021年第1号)	证监会规定网站	2021-06-30
11	西藏东财消费精选混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新(2021年6月30日)	证监会规定网站	2021-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

西藏东财基金管理有限公司
二〇二一年八月二十七日