
**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**

**（原西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金
转型）**

2022年第4季度报告

2022年12月31日

基金管理人：西藏东财基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

报告送出日期：2023年01月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2023年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年10月1日起至2022年12月31日止。其中，自2022年10月11日起，“西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金”转型为“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基金合同及托管协议即日生效。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	东财中证新能源车ETF发起式联接
基金主代码	010805
基金运作方式	契约型开放式
基金转型合同生效日	2022年10月11日
报告期末基金份额总额	817,020,891.34份
投资目标	本基金主要通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股及其备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金为ETF联接基金，且目标ETF为采用指数化操作的股票型基金，因此本基金的预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东财中证新能源车ETF发起式联接A	东财中证新能源车ETF发起式联接C
下属分级基金的交易代码	010805	010806
报告期末下属分级基金的份额总额	393,110,941.20份	423,909,950.14份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	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
基金主代码	159637
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022-08-19
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022-09-01
基金管理人名称	西藏东财基金管理有限公司
基金托管人名称	广发证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%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	中证新能源汽车指数收益率
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。

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	东财新能源车
基金主代码	010805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月16日
报告期末基金份额总额	800,342,948.90份
投资目标	本基金采用指数化投资策略, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化, 力争获取与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	<p>本基金原则上采用完全复制标的指数的方法, 进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整, 以达到复制和跟踪标的指数的目的。</p> <p>本基金在控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下, 力争获取与标的指数相似的投资收益。在正常市场情况下, 本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内, 年跟踪误差控制在4%以内。</p>

业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东财新能源车A	东财新能源车C
下属分级基金的交易代码	010805	010806
报告期末下属分级基金的份额总额	387,077,838.92份	413,265,109.98份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2022年10月11日 - 2022年12月31日)	
	东财中证新能源车ETF发起式联接A	东财中证新能源车ETF发起式联接C
1.本期已实现收益	-91,742,785.34	-98,513,301.10
2.本期利润	-14,883,025.53	-16,380,031.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0381	-0.0391
4.期末基金资产净值	439,666,281.57	470,268,606.63
5.期末基金份额净值	1.1184	1.1094

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、所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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、自2022年10月11日起,原西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金转型为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。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2022年10月01日 - 2022年10月10日)
--------	--------------------------------

	东财新能源车A	东财新能源车C
1.本期已实现收益	-20,539.14	-74,873.43
2.本期利润	-11,593,033.85	-12,341,292.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0300	-0.0300
4.期末基金资产净值	447,860,322.20	474,710,146.51
5.期末基金份额净值	1.1570	1.1487

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、所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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东财中证新能源车ETF发起式联接A净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	-3.34%	1.85%	-3.25%	1.87%	-0.09%	-0.02%

东财中证新能源车ETF发起式联接C净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	-3.42%	1.86%	-3.25%	1.87%	-0.17%	-0.01%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东财中证新能源车ETF发起式联接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



东财中证新能源车ETF发起式联接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



注：1、本基金于2022年10月11日由西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金转型而来。

2、本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金转型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。

3.2 基金净值表现(转型前)

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

东财新能源车A净值表现

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-26.81%	1.90%	-27.08%	1.90%	0.27%	0.00%
过去六个月	-6.51%	2.33%	-7.21%	2.33%	0.70%	0.00%
过去一年	-23.85%	2.21%	-24.76%	2.22%	0.91%	-0.01%
自基金合同生效起至2022年10月10日	15.70%	2.35%	19.40%	2.38%	-3.70%	-0.03%

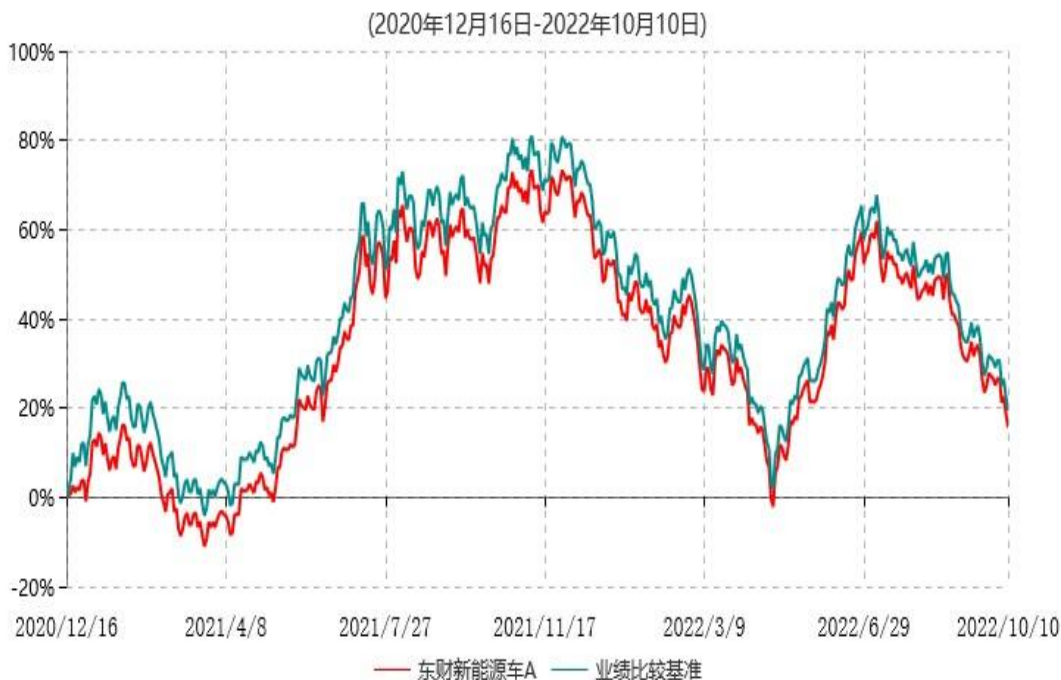
东财新能源车C净值表现

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-26.89%	1.90%	-27.08%	1.90%	0.19%	0.00%
过去六个月	-6.69%	2.33%	-7.21%	2.33%	0.52%	0.00%
过去一年	-24.15%	2.21%	-24.76%	2.22%	0.61%	-0.01%
自基金合同生效起至2022年10月10日	14.87%	2.35%	19.40%	2.38%	-4.53%	-0.03%

注：3.2.1表格中，过去三个月、过去六个月、过去一年指自2022年10月10日起过去三个月、过去六个月、过去一年。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

东财新能源车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



东财新能源车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



注：1、本基金基金合同于2020年12月16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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2020-12-16	-	12.5年	上海财经大学金融数学与金融工程硕士。自2010年6月始,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、西藏东财基金管理有限公司担任产品创新及量化投资部总监助理、基金管理部筹备组量化投资负责人、资产管理总部投资主办人、量化投资部总监、研究部总监、基金经理等职务。
姚楠燕	本基金基金经理	2020-12-16	-	5.5年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。自2013年8月始,先后在中欧国际工商学院、西藏东财基金管理有限公司筹备组、西藏东财基金管理有限公司担任金融学/会计学研究助理、筹备组成员、基金经理兼基金经理助理兼研究员等职务。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

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

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是基金费用、申购赎回、交易成本、网下新股申购等因素。当申赎变动、成份股调整、成份股停牌等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，保持基金整体运行平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2022年10月10日，东财新能源车A份额净值为1.1570元，自2022年10月1日至2022年10月10日基金份额净值增长率为-2.53%，东财新能源车C份额净值为1.1487元，自2022年10月1日至2022年10月10日基金份额净值增长率为-2.53%，同期业绩比较基准收益率为-2.52%。

截至2022年12月31日，东财中证新能源车ETF发起式联接A份额净值为1.1184元，自2022年10月11日至2022年12月31日基金份额净值增长率为-3.34%，东财中证新能源车

ETF发起式联接C份额净值为1.1094元,自2022年10月11日至2022年12月31日基金份额净值增长率为-3.42%,同期业绩比较基准收益率为-3.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金未发生相关预警情形。

§5 投资组合报告(转型后)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,067,799.99	0.12
	其中:股票	1,067,799.99	0.12
2	基金投资	860,104,266.40	94.15
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	52,204,480.14	5.71
8	其他资产	173,199.30	0.02
9	合计	913,549,745.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	728,824.90	0.08
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	-	-
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	255,020.89	0.03
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	38,283.70	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	40,066.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,067,799.99	0.12

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688322	奥比中光	8,529	182,350.02	0.02
2	688247	宣泰医药	7,155	107,754.30	0.01
3	301269	华大九天	1,080	94,975.20	0.01
4	688667	菱电电控	858	74,663.16	0.01
5	301095	广立微	740	64,002.60	0.01
6	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
7	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
8	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00

9	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
10	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	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	股票型	交易型开放式	西藏东财基金管理有限公司	860,104,266.40	94.52

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	173,199.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	173,199.30

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688322	奥比中光	182,350.02	0.02	科创板新股限售
2	688247	宣泰医药	107,754.30	0.01	科创板新股限售
3	301269	华大九天	94,975.20	0.01	创业板新股限售
4	301095	广立微	64,002.60	0.01	创业板新股限售
5	301327	华宝新能	42,826.74	0.00	创业板新股限售
6	301239	普瑞眼科	40,066.00	0.00	创业板新股限售
7	301175	中科环保	38,283.70	0.00	创业板新股限售

8	301301	川宁生物	26,912.22	0.00	创业板新股限售
9	301195	北路智控	24,103.20	0.00	创业板新股限售

5.12.6 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。

§5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	876,448,067.88	94.16
	其中：股票	876,448,067.88	94.16
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	53,474,592.40	5.75
8	其他资产	852,219.55	0.09
9	合计	930,774,879.83	100.00

注：截至2022年10月10日，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为133,242,570.00元，占基金资产净值比例为14.44%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

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	20,356,716.00	2.21
C	制造业	839,170,758.67	90.96
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	-	-
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	-	-
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	14,527,365.00	1.57
	合计	874,054,839.67	94.74

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,724,686.82	0.19
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	-	-
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	311,816.80	0.03
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	236,484.12	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	82,993.22	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	31,780.25	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,467.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,393,228.21	0.26

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300750	宁德时代	225,900	88,747,074.00	9.62
2	002594	比亚迪	330,820	83,101,984.00	9.01
3	300124	汇川技术	949,263	55,000,298.22	5.96
4	002466	天齐锂业	531,901	51,605,035.02	5.59
5	300014	亿纬锂能	582,854	47,852,313.40	5.19
6	002812	恩捷股份	275,454	46,122,017.76	5.00
7	002460	赣锋锂业	579,299	41,854,352.75	4.54

8	603799	华友钴业	653,298	40,373,816.40	4.38
9	002709	天赐材料	693,100	28,832,960.00	3.13
10	300450	先导智能	563,101	26,217,982.56	2.84

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	688320	禾川科技	6,048	243,855.36	0.03
2	688459	哈铁科技	17,259	234,377.22	0.03
3	688073	毕得医药	2,544	223,872.00	0.02
4	688153	唯捷创芯	6,788	218,030.56	0.02
5	688322	奥比中光	8,529	196,764.03	0.02

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

赣锋锂业：2022年7月1日，江西赣锋锂业股份有限公司收到中国证券监督管理委员会的立案告知书。

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新能源汽车指数，赣锋锂业为指数成份股。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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	836,745.00
6	其他应收款	15,474.55
7	其他	-
8	合计	852,219.55

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002812	恩捷股份	16,744,000.00	1.81	转融通证券出借
2	002466	天齐锂业	15,106,014.00	1.64	转融通证券出借
3	300750	宁德时代	12,689,378.00	1.38	转融通证券出借
4	300014	亿纬锂能	9,170,570.00	0.99	转融通证券出

					借
5	002709	天赐材料	7,816,640.00	0.85	转融通证券出借
6	002594	比亚迪	7,536,000.00	0.82	转融通证券出借
7	300450	先导智能	4,199,712.00	0.46	转融通证券出借
8	603799	华友钴业	3,201,240.00	0.35	转融通证券出借
9	300124	汇川技术	2,584,124.00	0.28	转融通证券出借
10	002460	赣锋锂业	1,445,000.00	0.16	转融通证券出借

5.11.5.2 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	688320	禾川科技	243,855.36	0.03	科创板新股限售
2	688459	哈铁科技	234,377.22	0.03	新股未上市
3	688073	毕得医药	223,872.00	0.02	新股未上市
4	688153	唯捷创芯	218,030.56	0.02	科创板新股限售
5	688322	奥比中光	196,764.03	0.02	科创板新股限售

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	东财中证新能源车ETF 发起式联接A	东财中证新能源车ETF 发起式联接C
基金合同生效日(2022年10月11日)基金份额总额	387,077,838.92	413,265,109.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	47,842,774.13	127,739,495.78
减: 基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	41,809,671.85	117,094,655.62
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	393,110,941.20	423,909,950.14

注: 1、其中“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。

2、自2022年10月11日起,原西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金转型为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。

§6 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

	东财新能源车A	东财新能源车C
报告期期初基金份额总额	386,638,061.78	411,664,473.30
报告期期间基金总申购份额	1,773,001.14	3,483,071.40
减: 报告期期间基金总赎回份额	1,333,224.00	1,882,434.72
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	387,077,838.92	413,265,109.98

注: 其中“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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

	东财中证新能源车ETF 发起式联接A	东财中证新能源车ETF 发起式联接C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	10,724,930.24	-
基金合同生效日起至报告期期末买	-	-

入/申购总份额		
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,724,930.24	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.73	-

注：1、其中“买入/申购”含红利再投、转换入份额；“卖出/赎回”含转换出份额。

2、本基金于2020年12月16日成立。本公司于2020年12月10日运用自有资金10,001,000.00元认购本基金A类份额10,000,450.05份，认购费用1,000.00元，符合招募说明书规定的认购费率；于2022年3月4日运用自有资金1,000,600.00元申购本基金A类份额724,480.19份，1折后申购费率0.0006，符合招募说明书规定的申购费率。

3、自2022年10月11日起，原西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金转型为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。

7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§7 基金管理人运用自有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	东财新能源车A	东财新能源车C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,724,930.24	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,724,930.24	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.77	-

注：1、其中“买入/申购”含红利再投、转换入份额；“卖出/赎回”含转换出份额。

2、本基金于2020年12月16日成立。本公司于2020年12月10日运用自有资金10,001,000.00元认购本基金A类份额10,000,450.05份，认购费用1,000.00元，符合招募说明书规定的认购费率；于2022年3月4日运用自有资金1,000,600.00元申购本基金A类份额724,480.19份，1折后申购费率0.0006，符合招募说明书规定的申购费率。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况(转型后)

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	10,724,930.24	1.31%	10,000,450.05	1.22%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,724,930.24	1.31%	10,000,450.05	1.22%	3年

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况（转型前）

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	10,724,930.24	1.34%	10,000,450.05	1.25%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,724,930.24	1.34%	10,000,450.05	1.25%	3年

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

一、中国证监会准予西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金募集注册的文件

二、《西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金基金合同》

三、《西藏东财中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金托管协议》

四、《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基金合同》

五、《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托管协议》

六、法律意见书

七、基金管理人业务资格批件、营业执照

八、基金托管人业务资格批件、营业执照

九、中国证监会要求的其他文件

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

10.3 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

2023年01月21日