
西藏东财中证 500 指数型发起式证券投资基金

2023 年年度报告

2023 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:中国国际金融股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 30 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2024年03月18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。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	79
8.1 期末基金资产组合情况	79
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	80
8.3 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	82
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	102
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	104
8.6 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	104
8.7 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	104
8.8 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	105
8.9 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	105
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	105

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	105
8.12 投资组合报告附注	105
§9 基金份额持有人信息	106
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	106
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	107
9.3 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	107
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	107
§10 开放式基金份额变动	108
§11 重大事件揭示	108
11.1 基金份额持有人大会决议	108
11.2 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	108
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	109
11.4 基金投资策略的改变	109
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	109
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	109
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	109
11.8 其他重大事件	110
§12 影响投资者决策的其他重要信息	111
12.1 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	111
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	112
§13 备查文件目录	112
13.1 备查文件目录	112
13.2 存放地点	112
13.3 查阅方式	112

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金	
基金简称	东财中证500	
基金主代码	010992	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年01月20日	
基金管理人	西藏东财基金管理有限公司	
基金托管人	中国国际金融股份有限公司	
报告期末基金份额总额	229,960,537.84份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财中证500A	东财中证500C
下属分级基金的交易代码	010992	010993
报告期末下属分级基金的份额总额	153,874,609.62份	76,085,928.22份

2.2 基金产品说明

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	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。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。
业绩比较基准	中证500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。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路222号21楼

注册登记机关	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023年		2022年		2021年01月20日 (基金合同生效日) - 2021年12月31日	
	东财中证500A	东财中证500C	东财中证500A	东财中证500C	东财中证500A	东财中证500C
本期已实现收益	-875,919.49	-800,536.53	2,316,743.71	644,132.40	25,320,783.65	11,093,059.46
本期利润	-4,484,720.84	-3,033,004.59	-32,211,146.05	-13,309,911.89	38,397,034.13	17,010,337.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0294	-0.0413	-0.1915	-0.2052	0.1758	0.1607
本期加权平均净值利润率	-2.87%	-4.08%	-18.50%	-19.94%	16.53%	15.21%
本期基金份额净值增长率	-3.45%	-3.85%	-16.42%	-16.75%	18.84%	18.39%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	-6,314,162.77	-3,978,060.55	-1,079,856.38	-968,307.36	22,227,472.12	8,815,337.61
期末可供分配基金份额利润	-0.0410	-0.0523	-0.0067	-0.0144	0.1293	0.1249
期末基金资产净值	147,560,446.85	72,107,867.67	160,453,920.48	66,277,907.59	204,330,103.52	83,580,176.88
期末基金份额净值	0.9590	0.9477	0.9933	0.9856	1.1884	1.1839
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	-4.10%	-5.23%	-0.67%	-1.44%	18.84%	18.39%

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

东财中证500A

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
过去三个月	-3.86%	0.82%	-4.36%	0.82%	0.50%	0.00%
过去六个月	-7.22%	0.81%	-9.01%	0.81%	1.79%	0.00%
过去一年	-3.45%	0.78%	-7.01%	0.78%	3.56%	0.00%
自基金合同生效起至今	-4.10%	1.02%	-15.21%	1.03%	11.11%	-0.01%

东财中证500C

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
过去三个月	-3.96%	0.82%	-4.36%	0.82%	0.40%	0.00%
过去六个月	-7.42%	0.81%	-9.01%	0.81%	1.59%	0.00%
过去一年	-3.85%	0.78%	-7.01%	0.78%	3.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	-5.23%	1.02%	-15.21%	1.03%	9.98%	-0.01%

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

东财中证500A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年01月20日-2023年12月31日)



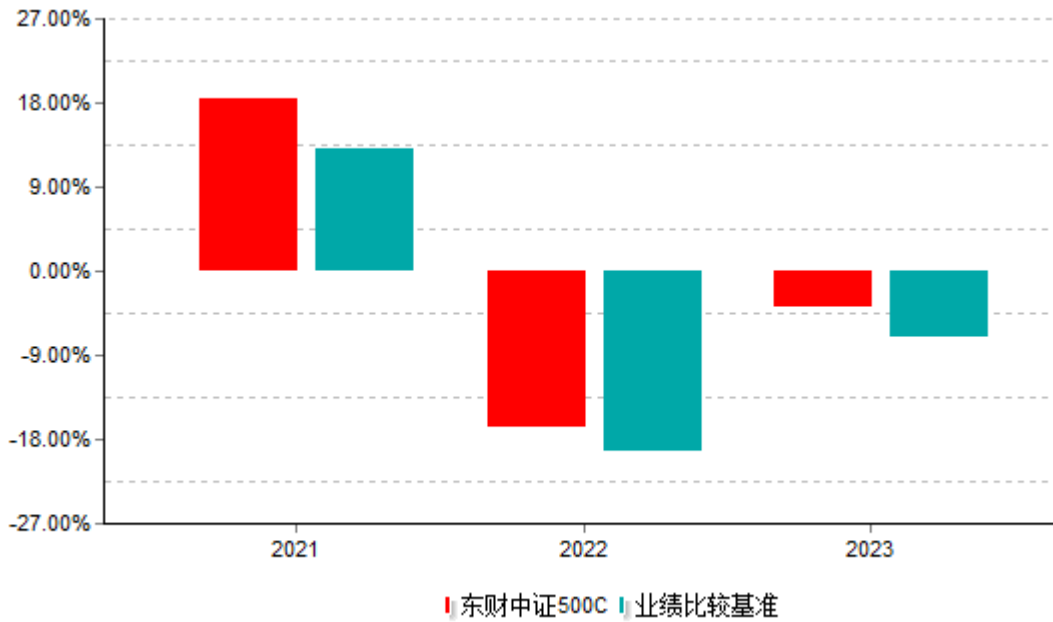
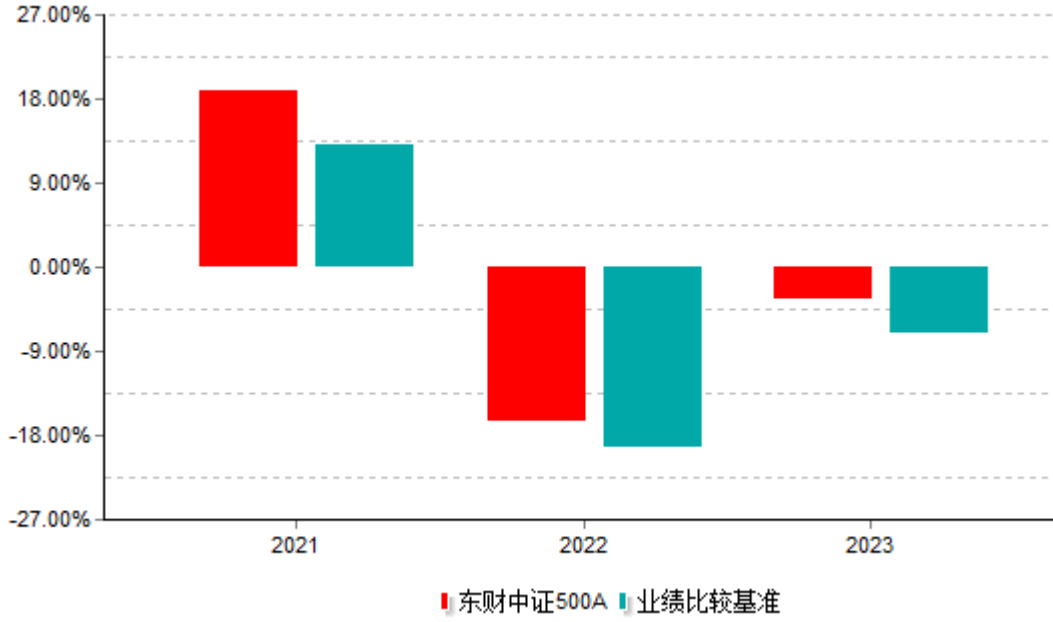
东财中证500C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年01月20日-2023年12月31日)



注：1、本基金基金合同于2021年1月20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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于2021年1月20日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于2021年1月20日生效，自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

§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2023年12月31日，公司旗下管理42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、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、西藏东财创新医疗六个月定期开放混合型发起式证券投资基金、西藏东财中证芯片产业指数型发起式证券投资基金、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、西藏东财中证沪港深创新药产业指数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指数型发起式证券投资基金、西藏东财品质生活优选混合型发起式证券投资基金、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。

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		
姚楠燕	本基金基金经理	2021-01-20	-	6.5年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。自2013年8月开始，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。
莫志刚	本基金基金经理助理	2022-10-31	-	10.5年	南京大学计算机技术专业硕士。自2013年4月始，先后在万家基金管理有限公司、南华基金管理有限公司、西藏东财基金管理有限公司担任量化研究员、基金经理、基金经理兼基金经理助理等职务。

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 公平交易制度和控制方法

本基金基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及公司内部制度，制定了《公平交易管理制度》。

本基金基金管理人建立科学规范的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露确保公平交易过程和结果的监督。

在投资决策的内部控制方面，研究员根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围等，建立不同投资组合的投资对象备选库，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。交易执行中，交易员执行投资交易系统内的公平交易程序，并严格按照价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的原则执行交易指令，确保交易执行的公平性。

行为监控方面，建立了有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，并建立相关记录制度，确保公平交易可稽核；对交易价格的公允性进行审查，相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）对不同投资组合的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控和分析。

4.3.2 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。

4.3.3 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

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年12月31日，东财中证500A份额净值为0.9590元，报告期内基金份额净值增长率为-3.45%，东财中证500C份额净值为0.9477元，报告期内基金份额净值增长率为-3.85%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年，宏观经济总体处于弱复苏状态，全年社零额、出口、固定资产投资、工业增加值等主要经济指标呈现波浪曲折走势，呈现出1至3月走高，4至7月回调，8至9月改善，10至12月再次边际回调的过程。工业增加值同比、社零额同比、社融同比、固定资产投资同比等主要经济数据均低于常态水平。总体而言，目前我国处于通胀、库存和盈利等多周期触底反弹的共振阶段，伴随增长动力结构性调整，新旧动能持续转换，经济复苏进程或延续推进。

资本市场方面，各类资产表现分化，避险资产表现整体优于风险资产。股票市场整体呈波动下跌走势，上证综指、深证成指、创业板指均有所下跌，跌幅分别为3.7%、13.5%、19.4%。

行业方面，申万一级行业指数涨跌互现，科技板块表现强势，地产消费疲软，全年来看，通信、传媒、计算机、电子领涨；美容护理、商贸零售、房地产领跌。展望2024年，大类行业比较来看，产业趋势向好、受益于流动性宽松的软、硬科技，受益于CPI修复、海外美债利率下行的必选消费特别是核心资产相对占优。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金基金管理人坚持投资者利益至上、坚持违法违规零容忍、严防触犯三条底线作为公司的最高经营宗旨和全体员工的根本行为准则，为全面风险管理、全程风险管理与全员风险管理相关内部控制管理规范的推行提供相对有利的内部控制环境；同时依据不断发展变化的外部经营环境、监管环境与业务实践对于公司内部控制与风险管理持续进行动态的调整与修正。本基金基金管理人根据法律法规、监管政策的变化和业务发展情况，从合规运作、维护基金份额持有人利益的角度出发，持续完善内部控制制度和流程，加强内部风险的控制与防范，确保内控体系和各项制度措施的落实，有效保障了公司各项业务合法合规的有序开展。

报告期内，本基金的监察稽核主要工作情况如下：一是执行监察稽核信息动态通报与执行跟进机制，及时进行内部传达以及组织员工学习理解；二是通过相关内部以及外部合规风控培训、日常投资申报管理、员工行为规范管理等方式不断强化员工的合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突；三是协调内部管理制度体系的修订和完善，推动公司各业务部门持续完善各项管理制度和业务流程建设，防范日常运作中发生违法违规与风险事件；四是执行基金运作过程中的临时公告、定期报告、招募说明书更新等相关信息披露工作；五是采取事前、事中和事后三阶段的防范控制工作，从投资决策、研究支持、交易执行、投资监督与风险管理、关联交易管理、公平交易与异常交易监控、内幕交易防控等各方面持续加强对于投资管理业务的内部控制，保障基金投资运作合法合规；六是对基金运作过程中的营销与销售、会计核算估值、信息技术支持等方面进行内部控制与合规管理；七是通过独立开展定期或不定期内部审计，监督检查各业务条线相关内部控制措施设计的合理性以及执行的有效性，针对发现的问题相应提出改进建议并督促相关业务部门及时落实改进措施；八是重视反洗钱各项工作，包括制度建设、系统功能优化、宣传培训、日常监测等方面，积极采取有效的防范措施控制洗钱的风险。

报告期内，本基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。本基金基金管理人将继续坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满3年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“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”的披露规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报（审）字（24）第P00739号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	西藏东财基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形

	<p>式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则以及中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，</p>

	<p>作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴凌志、胡本竞
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路222号21楼
审计报告日期	2024-03-29

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	11,890,313.00	12,681,656.06
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	208,436,801.82	214,549,149.48
其中：股票投资		208,436,801.82	214,549,149.48
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		27,159.18	33,847.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	13,356.27	5,767.69
资产总计		220,367,630.27	227,270,421.00
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		304,300.34	144,253.67
应付管理人报酬		93,591.97	96,640.27
应付托管费		9,359.19	9,664.04
应付销售服务费		24,561.14	21,263.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,044.44	1,359.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	265,458.67	265,412.84
负债合计		699,315.75	538,592.93
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	229,960,537.84	228,779,991.81
未分配利润	7.4.7.8	-10,292,223.32	-2,048,163.74
净资产合计		219,668,314.52	226,731,828.07
负债和净资产总计		220,367,630.27	227,270,421.00

注：报告截止日2023年12月31日，东财中证500A基金份额净值人民币0.9590元，基金份额总额153,874,609.62份；东财中证500C基金份额净值人民币0.9477元，基金份额总额76,085,928.22份。基金份额总额合计为229,960,537.84份。

7.2 利润表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
一、营业总收入		-5,755,295.00	-43,731,968.23
1.利息收入		813,940.16	351,622.64
其中：存款利息收入	7.4.7.9	66,891.36	69,549.19

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		747,048.80	282,073.45
2.投资收益（损失以“-”填列）		-732,414.04	4,369,346.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-4,319,755.18	369,425.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	3,587,341.14	3,999,921.03
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-5,841,269.41	-48,481,934.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,448.29	28,997.00
减：二、营业总支出		1,762,430.43	1,789,089.71
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,154,003.72	1,204,609.88
2.托管费	7.4.10.2.2	115,400.43	120,460.98
3.销售服务费	7.4.10.2.3	297,349.94	267,232.25
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	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		2,690.81	1,016.04
8.其他费用	7.4.7.19	192,985.53	195,770.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,517,725.43	-45,521,057.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,517,725.43	-45,521,057.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,517,725.43	-45,521,057.94

7.3 净资产变动表

会计主体：西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	228,779,991.81	-2,048,163.74	226,731,828.07
二、本期期初净资产	228,779,991.81	-2,048,163.74	226,731,828.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,180,546.03	-8,244,059.58	-7,063,513.55
（一）、综合收益总额	-	-7,517,725.43	-7,517,725.43
（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	1,180,546.03	-726,334.15	454,211.88

列)			
其中：1.基金申购款	80,843,378.90	1,220,402.04	82,063,780.94
2.基金赎回款	-79,662,832.87	-1,946,736.19	-81,609,569.06
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	229,960,537.84	-10,292,223.32	219,668,314.52
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	242,537,370.03	45,372,910.37	287,910,280.40
二、本期期初净资产	242,537,370.03	45,372,910.37	287,910,280.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-13,757,378.22	-47,421,074.11	-61,178,452.33
(一)、综合收益总额	-	-45,521,057.94	-45,521,057.94
(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)	-13,757,378.22	-1,900,016.17	-15,657,394.39
其中：1.基金申购款	96,690,099.32	3,335,432.57	100,025,531.89
2.基金赎回款	-110,447,477.54	-5,235,448.74	-115,682,926.28

（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	228,779,991.81	-2,048,163.74	226,731,828.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

西藏东财中证500指数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《西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财中证500指数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]3222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405,219,850.31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（21）第00018号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2021年1月20日正式生效。本基金的基金管理人为西藏东财基金管理有限公司，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

根据《西藏东财中证500指数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（非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册上市的股票）、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及转融通证券出借业务。本基金股票资产投资比例为本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率（税后） \times 5%。

7.4.2 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。

7.4.3 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2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证

券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

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

（3）公允价值变动收益

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

（4）信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

（5）其他收入

在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的该类别基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配有关业务规则进行调整，无需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 根据中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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]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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	4,704,358.05	5,582,853.69
等于：本金	4,703,284.91	5,581,568.38
加：应计利息	1,073.14	1,285.31
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	7,185,954.95	7,098,802.37
等于：本金	7,184,894.95	7,097,810.85
加：应计利息	1,060.00	991.52
减：坏账准备	-	-
合计	11,890,313.00	12,681,656.06

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	243,766,476.75	-	208,436,801.82	-35,329,674.93
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	243,766,476.75	-	208,436,801.82	-35,329,674.93
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	244,037,555.00	-	214,549,149.48	-29,488,405.52
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	244,037,555.00	-	214,549,149.48	-29,488,405.52

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	13,356.27	5,767.69
待摊费用	-	-

合计	13,356.27	5,767.69
----	-----------	----------

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	68.88	3.40
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	24,000.00	24,000.00
预提费用-信息披露费	230,000.00	230,000.00
其他应付	11,389.79	11,409.44
合计	265,458.67	265,412.84

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 东财中证500A

金额单位：人民币元

项目 (东财中证500A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	161,533,776.86	161,533,776.86
本期申购	31,834,249.08	31,834,249.08
本期赎回（以“-”号填列）	-39,493,416.32	-39,493,416.32
本期末	153,874,609.62	153,874,609.62

7.4.7.7.2 东财中证500C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(东财中证500C)	2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	67,246,214.95	67,246,214.95
本期申购	49,009,129.82	49,009,129.82
本期赎回(以“-”号填列)	-40,169,416.55	-40,169,416.55
本期末	76,085,928.22	76,085,928.22

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 东财中证500A

单位：人民币元

项目 (东财中证500A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,121,338.20	-24,201,194.58	-1,079,856.38
本期期初	23,121,338.20	-24,201,194.58	-1,079,856.38
本期利润	-875,919.49	-3,608,801.35	-4,484,720.84
本期基金份额交易产生的变动数	-1,028,504.47	278,918.92	-749,585.55
其中：基金申购款	4,663,540.35	-3,910,105.56	753,434.79
基金赎回款	-5,692,044.82	4,189,024.48	-1,503,020.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,216,914.24	-27,531,077.01	-6,314,162.77

7.4.7.8.2 东财中证500C

单位：人民币元

项目 (东财中证500C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,046,918.44	-10,015,225.80	-968,307.36
本期期初	9,046,918.44	-10,015,225.80	-968,307.36
本期利润	-800,536.53	-2,232,468.06	-3,033,004.59
本期基金份额交易产生的变动数	1,286,469.86	-1,263,218.46	23,251.40

其中：基金申购款	6,698,449.58	-6,231,482.33	466,967.25
基金赎回款	-5,411,979.72	4,968,263.87	-443,715.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,532,851.77	-13,510,912.32	-3,978,060.55

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	41,818.57	45,260.18
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	25,072.79	24,289.01
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	66,891.36	69,549.19

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	104,369,312.50	130,739,921.21
减：卖出股票成本总额	108,397,440.59	129,951,883.91
减：交易费用	291,627.09	418,612.15
买卖股票差价收入	-4,319,755.18	369,425.15

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,587,341.14	3,999,921.03
其中：证券出借权益补偿收入	277,272.66	135,296.28
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,587,341.14	3,999,921.03

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	-5,841,269.41	-48,481,934.05
——股票投资	-5,841,269.41	-48,481,934.05
——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	-5,841,269.41	-48,481,934.05

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	4,368.19	13,804.60
转换费收入	80.10	15,192.40
合计	4,448.29	28,997.00

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	24,000.00	24,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	2,825.38	3,586.16
指数使用费	46,160.15	48,184.40
合计	192,985.53	195,770.56

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金托管人
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商
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：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；下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东财证券	200,735,538.23	100.00%	230,852,162.88	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东财证券	189,424.80	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东财证券	223,976.66	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。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,154,003.72	1,204,609.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	522,884.21	571,752.11
应支付基金管理人的净管理费	631,119.51	632,857.77

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	115,400.43	120,460.98

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

7.4.10.2.3 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		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财中证500A	东财中证500C	合计
西藏东财基金管理 有限公司	0.00	15,877.06	15,877.06
天天基金	0.00	179,347.50	179,347.50
东财证券	0.00	47,080.36	47,080.36
合计	0.00	242,304.92	242,304.92
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

名称	东财中证500A	东财中证500C	合计
西藏东财基金管理 有限公司	0.00	716.51	716.51
天天基金	0.00	207,015.71	207,015.71
东财证券	0.00	53,413.69	53,413.69
合计	0.00	261,145.91	261,145.91

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0.40%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：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

单位：人民币元

上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东财证券	5,453,118.00	3,844.43	-	-

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

7.4.10.4.2 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

单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费	利息收入	期末证券出借	期末应收利息

			率(%)		业务余额	余额
东财证券	12,033,706.00	3.00~3.60	3.01	13,746.07	728,378.00	165.44
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东财证券	111,675.00	3.60	3.60	156.35	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

东财中证500A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
报告期初持有的基金份额	10,899,819.83	10,000,458.38
报告期间申购/买入总份额	-	899,361.45
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,899,819.83	10,899,819.83
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.08%	6.75%

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、本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资C类基金份额。

7.4.10.5.2 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

东财中证500A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	6,534,957.42	4.25%	0.00	0.00%
------	--------------	-------	------	-------

注：1、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。

2、本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有C类基金份额。

7.4.10.6 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 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中金公司-托管户	4,704,358.05	41,818.57	5,582,853.69	45,260.18
东财证券-证券资金户	7,185,954.95	25,072.79	7,098,802.37	24,289.01

注：1、本基金的银行存款存放在托管人中金公司在招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中金公司的银行存款及利息收入。

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中金公司	002948	青岛银行	配股发行	9,600	30,720.00

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301487	盟固利	2023-08-01	6个月	创业板新股限售	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月	创业板新股限售	18.08	44.57	421	7,611.68	18,763.97	-
301421	波长光电	2023-08-16	6个月	创业板新股限售	29.38	59.37	253	7,433.14	15,020.61	-
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	创业板新股限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6个月	创业板新股限售	20.45	29.69	457	9,345.65	13,568.33	-
688627	精智达	2023-07-11	6个月	科创板新股限售	46.77	87.72	149	6,968.73	13,070.28	-

301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	创业板新股限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6个月	创业板新股限售	31.33	38.16	331	10,370.23	12,630.96	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月	科创板新股限售	9.87	12.75	918	9,060.66	11,704.50	-
301558	三态股份	2023-09-21	6个月	创业板新股限售	7.33	13.40	833	6,105.89	11,162.20	-
688592	司南导航	2023-08-07	6个月	科创板新股限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
301499	维科精密	2023-07-13	6个月	创业板新股限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
688563	航材股份	2023-07-12	6个月	科创板新股限售	78.99	60.49	170	13,428.30	10,283.30	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	科创板新股限售	26.74	38.67	263	7,032.62	10,170.21	-
688652	京仪	2023-11-22	6个	科创	31.95	52.25	188	6,006.60	9,823.00	-

	装备		月	板新 股限 售							
6886 03	天承 科技	2023- 06-30	6个 月	科创 板新 股限 售	55.00	74.14	129	7,09 5.00	9,56 4.06	-	
3014 13	安培 龙	2023- 12-11	6个 月	创业 板新 股限 售	33.25	58.19	164	5,45 3.00	9,54 3.16	-	
3015 16	中远 通	2023- 12-01	6个 月	创业 板新 股限 售	6.87	15.51	604	4,14 9.48	9,36 8.04	-	
3013 72	科净 源	2023- 08-03	6个 月	创业 板新 股限 售	45.00	43.59	213	9,58 5.00	9,28 4.67	-	
3012 91	明阳 电气	2023- 06-21	6个 月	创业 板新 股限 售	38.13	28.36	321	12,23 9.73	9,10 3.56	-	
6886 10	埃科 光电	2023- 07-10	6个 月	科创 板新 股限 售	73.33	51.00	176	12,90 6.08	8,97 6.00	-	
6885 91	泰凌 微	2023- 08-18	6个 月	科创 板新 股限 售	24.98	28.02	318	7,94 3.64	8,91 0.36	-	
3015 08	中机 认检	2023- 11-23	6个 月	创业 板新 股限 售	16.82	26.68	333	5,60 1.06	8,88 4.44	-	

				售							
688653	康希通信	2023-11-10	6个月	科创板新股限售	10.50	15.99	516	5,418.00	8,250.84	-	
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	科创板新股限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-	
688573	信宇人	2023-08-09	6个月	科创板新股限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-	
301362	民爆光电	2023-07-27	6个月	创业板新股限售	51.05	38.52	210	10,720.50	8,089.20	-	
688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月	科创板新股限售	39.90	46.05	175	6,982.50	8,058.75	-	
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	创业板新股限售	10.00	15.85	505	5,050.00	8,004.25	-	
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	创业板新股限售	19.99	19.35	412	8,235.88	7,972.20	-	
301272	英华特	2023-07-06	6个月	创业板新股限售	51.39	53.38	149	7,657.11	7,953.62	-	

301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	创业板新股限售	57.66	47.25	167	9,629.22	7,890.75	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	创业板新股限售	48.94	68.32	115	5,628.10	7,856.80	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月	科创板新股限售	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	创业板新股限售	57.88	45.48	168	9,723.84	7,640.64	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	创业板新股限售	36.90	50.85	150	5,535.00	7,627.50	-
301468	博盈特焊	2023-07-12	6个月	创业板新股限售	47.58	30.22	250	11,895.00	7,555.00	-
301533	威马农机	2023-08-07	6个月	创业板新股限售	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6个月	创业板新股限售	36.58	33.09	224	8,193.92	7,412.16	-
301489	思泉	2023-10-16	6个	创业	41.66	64.11	115	4,790.90	7,372.65	-

	新材		月	板新 股限 售							
3015 68	思泰 克	2023- 11-21	6个 月	创业 板新 股限 售	23.23	35.58	206	4,78 5.38	7,32 9.48	-	
3013 29	信音 电子	2023- 07-05	6个 月	创业 板新 股限 售	21.00	22.23	327	6,86 7.00	7,26 9.21	-	
3015 55	惠柏 新材	2023- 10-24	6个 月	创业 板新 股限 售	22.88	32.44	224	5,12 5.12	7,26 6.56	-	
3012 51	威尔 高	2023- 08-30	6个 月	创业 板新 股限 售	28.88	34.59	209	6,03 5.92	7,22 9.31	-	
3014 59	丰茂 股份	2023- 12-06	6个 月	创业 板新 股限 售	31.90	39.84	179	5,71 0.10	7,13 1.36	-	
3012 02	朗威 股份	2023- 06-28	6个 月	创业 板新 股限 售	25.82	31.80	221	5,70 6.22	7,02 7.80	-	
3015 11	德福 科技	2023- 08-08	6个 月	创业 板新 股限 售	28.00	22.67	309	8,65 2.00	7,00 5.03	-	
3015 05	苏州 规划	2023- 07-12	6个 月	创业 板新 股限 售	26.35	35.81	194	5,11 1.90	6,94 7.14	-	

				售						
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	创业板新股限售	26.87	43.69	157	4,218.59	6,859.33	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月	新股锁定	1.70	4.06	1,688	2,869.60	6,853.28	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	创业板新股限售	26.68	18.69	360	9,604.80	6,728.40	-
688638	誉辰智能	2023-07-04	6个月	科创板新股限售	83.90	59.68	111	9,312.90	6,624.48	-
301518	长华化学	2023-07-26	6个月	创业板新股限售	25.75	23.01	284	7,313.00	6,534.84	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月	创业板新股限售	20.93	20.21	322	6,739.46	6,507.62	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	创业板新股限售	51.88	50.20	129	6,692.52	6,475.80	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	创业板新股限售	71.80	68.91	92	6,605.60	6,339.72	-
688716	中研股份	2023-09-13	6个月	科创板新	29.66	36.39	174	5,160.84	6,331.86	-

				股限售						
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	创业板新股限售	37.56	43.57	142	5,333.52	6,186.94	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月	创业板新股限售	67.68	59.37	104	7,038.72	6,174.48	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	创业板新股限售	37.96	30.39	196	7,440.16	5,956.44	-
688693	锆威特	2023-08-10	6个月	科创板新股限售	40.83	43.41	136	5,552.88	5,903.76	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	科创板新股限售	8.66	11.06	530	4,589.80	5,861.80	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	科创板新股限售	69.98	60.10	97	6,788.06	5,829.70	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6个月	创业板新股限售	36.60	37.88	151	5,526.60	5,719.88	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	创业板新股限售	99.57	81.46	65	6,472.05	5,294.90	-

301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	创业板新股限售	23.97	20.89	252	6,040.44	5,264.28	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月	科创板新股限售	46.80	36.07	142	6,645.60	5,121.94	-
301559	中集环科	2023-09-26	6个月	创业板新股限售	24.22	18.24	275	6,660.50	5,016.00	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	创业板新股限售	67.88	52.74	93	6,312.84	4,904.82	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6个月	科创板新股限售	47.29	37.97	125	5,911.25	4,746.25	-
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月	新股锁定	31.68	31.27	150	4,752.00	4,690.50	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	创业板新股限售	55.68	37.58	124	6,904.32	4,659.92	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月	科创板新股限售	103.40	78.23	58	5,997.20	4,537.34	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月	创业板新股限售	66.80	58.99	75	5,010.00	4,424.25	-

				售						
0013 26	联域 股份	2023- 11-01	6个 月	新股 锁定	41.18	48.64	88	3,62 3.84	4,28 0.32	-
6010 83	锦江 航运	2023- 11-28	6个 月	新股 锁定	11.25	11.07	360	4,05 0.00	3,98 5.20	-
6884 50	光格 科技	2023- 07-17	6个 月	科创 板新 股限 售	53.09	36.42	108	5,73 3.72	3,93 3.36	-
6030 04	鼎龙 科技	2023- 12-20	6个 月	新股 锁定	16.80	31.19	121	2,03 2.80	3,77 3.99	-
0012 39	永达 股份	2023- 12-04	6个 月	新股 锁定	12.05	19.92	189	2,27 7.45	3,76 4.88	-
6032 70	金帝 股份	2023- 08-25	6个 月	新股 锁定	21.77	29.58	117	2,54 7.09	3,46 0.86	-
0013 06	夏厦 精密	2023- 11-09	6个 月	新股 锁定	53.63	75.36	45	2,41 3.35	3,39 1.20	-
6032 73	天元 智能	2023- 10-16	6个 月	新股 锁定	9.50	18.97	178	1,69 1.00	3,37 6.66	-
6033 73	安邦 护卫	2023- 12-13	6个 月	新股 锁定	19.10	34.75	88	1,68 0.80	3,05 8.00	-
0013 58	兴欣 新材	2023- 12-14	6个 月	新股 锁定	41.00	44.16	68	2,78 8.00	3,00 2.88	-
6031 19	浙江 荣泰	2023- 07-21	6个 月	新股 锁定	15.32	23.87	125	1,91 5.00	2,98 3.75	-
6031 07	上海 汽配	2023- 10-25	6个 月	新股 锁定	14.23	18.19	157	2,23 4.11	2,85 5.83	-
6030 62	麦加 芯彩	2023- 10-31	6个 月	新股 锁定	58.08	57.81	49	2,84 5.92	2,83 2.69	-
6032 75	众辰 科技	2023- 08-16	6个 月	新股 锁定	49.97	39.70	71	3,54 7.87	2,81 8.70	-
6031 93	润本 股份	2023- 10-09	6个 月	新股 锁定	17.38	16.66	153	2,65 9.14	2,54 8.98	-

603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股锁定	25.73	24.88	102	2,624.46	2,537.76	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股锁定	21.29	21.53	100	2,129.00	2,153.00	-
603075	热威股份	2023-09-01	6个月	新股锁定	23.10	23.31	91	2,102.10	2,121.21	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023-08-30	重大事项停牌	-	-	-	154,400	389,991.21	-	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值	数量(单)	期末估值
---	------	------	-------	------	-------	------

号				单价	位：股)	总额
1	000021	深科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	16.21	12,100	196,141.00
2	000031	大悦城	2024年01月09日- 2024年01月09日	2.97	16,600	49,302.00
3	000155	川能动力	2024年01月09日- 2024年01月09日	13.29	9,500	126,255.00
4	000156	华数传媒	2024年01月02日- 2024年01月02日	7.37	12,000	88,440.00
5	000400	许继电气	2024年01月09日- 2024年01月09日	21.96	9,200	202,032.00
6	000401	冀东水泥	2024年01月09日- 2024年01月09日	6.39	13,700	87,543.00
7	000402	金融街	2024年01月09日- 2024年01月09日	3.63	15,400	55,902.00
8	000519	中兵红箭	2024年01月02日- 2024年01月02日	14.04	10,800	151,632.00
9	000553	安道麦A	2024年01月09日- 2024年01月09日	6.94	5,600	38,864.00
10	000559	万向钱潮	2024年01月10日- 2024年01月10日	5.19	17,100	88,749.00
11	000581	威孚高科	2024年01月10日- 2024年01月10日	15.07	6,400	96,448.00
12	000623	吉林敖东	2024年01月09日- 2024年01月09日	15.14	12,000	181,680.00
13	000629	钒钛股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	3.28	60,200	197,456.00
14	000709	河钢股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	2.13	53,500	113,955.00
15	000723	美锦能源	2024年01月09日- 2024年01月09日	6.66	21,700	144,522.00
16	000778	新兴铸管	2024年01月12日-	3.82	31,000	118,420.00

			2024年01月12日			
17	000831	中国稀土	2024年01月12日- 2024年01月12日	27.67	8,200	226,894.00
18	000883	湖北能源	2024年01月02日- 2024年01月02日	4.23	25,300	107,019.00
19	000887	中鼎股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	12.37	10,200	126,174.00
20	000937	冀中能源	2024年01月02日- 2024年01月12日	7.14	13,700	97,818.00
21	000958	电投产融	2024年01月02日- 2024年01月02日	3.94	20,900	82,346.00
22	000959	首钢股份	2024年01月02日- 2024年01月02日	3.46	20,200	69,892.00
23	000967	盈峰环境	2024年01月02日- 2024年01月02日	4.75	16,400	77,900.00
24	000975	银泰黄金	2024年01月12日- 2024年01月12日	15.00	25,100	376,500.00
25	000988	华工科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	29.76	13,000	386,880.00
26	000997	新大陆	2024年01月12日- 2024年01月12日	19.61	10,600	207,866.00
27	001286	陕西能源	2024年01月02日- 2024年01月02日	8.55	9,700	82,935.00
28	001872	招商港口	2024年01月09日- 2024年01月09日	15.96	3,000	47,880.00
29	001914	招商积余	2024年01月02日- 2024年01月02日	11.96	5,400	64,584.00
30	002008	大族激光	2024年01月09日- 2024年01月09日	20.72	10,900	225,848.00
31	002010	传化智联	2024年01月02日- 2024年01月02日	4.62	18,000	83,160.00
32	002028	思源电气	2024年01月12日-	52.04	8,000	416,320.00

			2024年01月12日			
33	002080	中材科技	2024年01月12日- 2024年01月12日	15.92	8,600	136,912.00
34	002120	韵达股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	7.46	18,700	139,502.00
35	002131	利欧股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	2.28	87,400	199,272.00
36	002155	湖南黄金	2024年01月02日- 2024年01月02日	11.14	10,800	120,312.00
37	002156	通富微电	2024年01月10日- 2024年01月10日	23.12	13,700	316,744.00
38	002192	融捷股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	54.21	2,600	140,946.00
39	002195	岩山科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	3.07	74,100	227,487.00
40	002244	滨江集团	2024年01月12日- 2024年01月12日	7.27	16,100	117,047.00
41	002273	水晶光电	2024年01月12日- 2024年01月12日	13.54	13,300	180,082.00
42	002281	光迅科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	28.50	5,100	145,350.00
43	002326	永太科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	11.62	9,400	109,228.00
44	002368	太极股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	29.53	5,600	165,368.00
45	002385	大北农	2024年01月05日- 2024年01月05日	5.96	42,800	255,088.00
46	002407	多氟多	2024年01月09日- 2024年01月09日	15.22	12,300	187,206.00
47	002423	中粮资本	2024年01月02日- 2024年01月02日	6.68	11,900	79,492.00
48	002429	兆驰股份	2024年01月09日-	5.58	29,300	163,494.00

			2024年01月09日			
49	002432	九安医疗	2024年01月10日- 2024年01月10日	37.67	5,000	188,350.00
50	002444	巨星科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	22.52	9,300	209,436.00
51	002463	沪电股份	2024年01月10日- 2024年01月10日	22.12	17,200	380,464.00
52	002468	申通快递	2024年01月02日- 2024年01月02日	7.79	9,900	77,121.00
53	002487	大金重工	2024年01月09日- 2024年01月09日	26.62	4,900	130,438.00
54	002497	雅化集团	2024年01月12日- 2024年01月12日	13.09	14,900	195,041.00
55	002505	鹏都农牧	2024年01月02日- 2024年01月02日	1.60	49,500	79,200.00
56	002506	协鑫集成	2024年01月12日- 2024年01月12日	2.74	60,600	166,044.00
57	002517	恺英网络	2024年01月09日- 2024年01月09日	11.17	27,800	310,526.00
58	002518	科士达	2024年01月09日- 2024年01月09日	27.60	3,000	82,800.00
59	002531	天顺风能	2024年01月09日- 2024年01月09日	11.60	11,600	134,560.00
60	002563	森马服饰	2024年01月02日- 2024年01月02日	5.77	10,400	60,008.00
61	002568	百润股份	2024年01月05日- 2024年01月05日	24.61	5,800	142,738.00
62	002572	索菲亚	2024年01月09日- 2024年01月09日	15.95	8,200	130,790.00
63	002608	江苏国信	2024年01月02日- 2024年01月02日	6.57	9,800	64,386.00
64	002624	完美世界	2024年01月09日-	11.84	17,600	208,384.00

			2024年01月09日			
65	002625	光启技术	2024年01月09日- 2024年01月09日	14.78	19,500	288,210.00
66	002670	国盛金控	2024年01月12日- 2024年01月12日	9.32	15,000	139,800.00
67	002683	广东宏大	2024年01月09日- 2024年01月09日	20.08	5,800	116,464.00
68	002690	美亚光电	2024年01月02日- 2024年01月02日	19.64	4,500	88,380.00
69	002738	中矿资源	2024年01月12日- 2024年01月12日	37.31	7,500	279,825.00
70	002739	万达电影	2024年01月10日- 2024年01月10日	13.02	17,500	227,850.00
71	002756	永兴材料	2024年01月12日- 2024年01月12日	52.21	1,400	73,094.00
72	002761	浙江建投	2024年01月09日- 2024年01月09日	10.26	7,000	71,820.00
73	002791	坚朗五金	2024年01月09日- 2024年01月09日	40.49	1,600	64,784.00
74	002831	裕同科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	27.51	4,800	132,048.00
75	002850	科达利	2024年01月09日- 2024年01月09日	84.46	1,700	143,582.00
76	002925	盈趣科技	2024年01月02日- 2024年01月02日	19.47	4,000	77,880.00
77	002936	郑州银行	2024年01月12日- 2024年01月12日	2.01	73,200	147,132.00
78	002945	华林证券	2024年01月12日- 2024年01月12日	15.10	3,400	51,340.00
79	003022	联泓新科	2024年01月09日- 2024年01月09日	18.31	5,200	95,212.00
80	300017	网宿科技	2024年01月12日-	7.85	31,500	247,275.00

			2024年01月12日			
81	300024	机器人	2024年01月12日- 2024年01月12日	11.87	16,000	189,920.00
82	300026	红日药业	2024年01月09日- 2024年01月09日	4.24	31,100	131,864.00
83	300058	蓝色光标	2024年01月10日- 2024年01月10日	7.18	32,200	231,196.00
84	300073	当升科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	38.20	2,800	106,960.00
85	300114	中航电测	2024年01月09日- 2024年01月09日	43.75	3,800	166,250.00
86	300118	东方日升	2024年01月05日- 2024年01月12日	17.65	11,700	206,505.00
87	300212	易华录	2024年01月09日- 2024年01月09日	31.45	5,600	176,120.00
88	300257	开山股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	15.76	5,100	80,376.00
89	300285	国瓷材料	2024年01月12日- 2024年01月12日	23.12	3,000	69,360.00
90	300363	博腾股份	2024年01月02日- 2024年01月02日	25.15	4,200	105,630.00
91	300383	光环新网	2024年01月05日- 2024年01月05日	9.72	18,600	180,792.00
92	300390	天华新能	2024年01月02日- 2024年01月09日	25.35	6,600	167,310.00
93	300394	天孚通信	2024年01月12日- 2024年01月12日	91.52	3,300	302,016.00
94	300418	昆仑万维	2024年01月09日- 2024年01月09日	37.40	11,000	411,400.00
95	300438	鹏辉能源	2024年01月09日- 2024年01月09日	28.29	4,500	127,305.00
96	300474	景嘉微	2024年01月05日-	70.71	2,000	141,420.00

			2024年01月05日			
97	300502	新易盛	2024年01月09日- 2024年01月09日	49.32	9,200	453,744.00
98	300568	星源材质	2024年01月09日- 2024年01月09日	15.42	1,000	15,420.00
99	300595	欧普康视	2024年01月09日- 2024年01月09日	22.58	6,900	155,802.00
10 0	300677	英科医疗	2024年01月09日- 2024年01月09日	23.36	5,900	137,824.00
10 1	300699	光威复材	2024年01月12日- 2024年01月12日	26.67	6,600	176,022.00
10 2	300748	金力永磁	2024年01月02日- 2024年01月02日	20.22	8,800	177,936.00
10 3	300776	帝尔激光	2024年01月12日- 2024年01月12日	60.26	1,700	102,442.00
10 4	300850	新强联	2024年01月09日- 2024年01月09日	31.83	2,300	73,209.00
10 5	300861	美畅股份	2024年01月02日- 2024年01月02日	33.29	2,400	79,896.00
10 6	300888	稳健医疗	2024年01月09日- 2024年01月09日	37.25	3,000	111,750.00
10 7	301029	怡合达	2024年01月12日- 2024年01月12日	25.78	2,200	56,716.00
10 8	301236	软通动力	2024年01月09日- 2024年01月09日	46.20	7,400	341,880.00
10 9	600022	山东钢铁	2024年01月12日- 2024年01月12日	1.37	69,200	94,804.00
11 0	600032	浙江新能	2024年01月09日- 2024年01月09日	8.06	2,800	22,568.00
11 1	600056	中国医药	2024年01月10日- 2024年01月10日	11.17	9,600	107,232.00
11 2	600062	华润双鹤	2024年01月12日-	18.60	5,400	100,440.00

			2024年01月12日			
11 3	600096	云天化	2024年01月09日- 2024年01月09日	15.60	14,000	218,400.00
11 4	600118	中国卫星	2024年01月12日- 2024年01月12日	25.82	7,600	196,232.00
11 5	600141	兴发集团	2024年01月09日- 2024年01月09日	18.25	10,000	182,500.00
11 6	600143	金发科技	2024年01月04日- 2024年01月04日	7.99	24,200	193,358.00
11 7	600155	华创云信	2024年01月12日- 2024年01月12日	8.34	29,200	243,528.00
11 8	600157	永泰能源	2024年01月09日- 2024年01月09日	1.37	287,700	394,149.00
11 9	600160	巨化股份	2024年01月12日- 2024年01月12日	16.49	17,400	286,926.00
12 0	600167	联美控股	2024年01月02日- 2024年01月02日	5.67	11,800	66,906.00
12 1	600170	上海建工	2024年01月12日- 2024年01月12日	2.34	80,500	188,370.00
12 2	600208	新湖中宝	2024年01月09日- 2024年01月09日	2.17	55,100	119,567.00
12 3	600299	安迪苏	2024年01月02日- 2024年01月02日	8.00	5,200	41,600.00
12 4	600315	上海家化	2024年01月02日- 2024年01月02日	21.18	4,400	93,192.00
12 5	600329	达仁堂	2024年01月09日- 2024年01月09日	33.65	3,600	121,140.00
12 6	600339	中油工程	2024年01月02日- 2024年01月02日	3.03	21,600	65,448.00
12 7	600373	中文传媒	2024年01月09日- 2024年01月09日	13.18	8,700	114,666.00
12 8	600377	宁沪高速	2024年01月02日-	10.25	6,400	65,600.00

			2024年01月02日			
129	600378	昊华科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	30.48	3,500	106,680.00
130	600398	海澜之家	2024年01月09日- 2024年01月09日	7.42	22,300	165,466.00
131	600418	江淮汽车	2024年01月09日- 2024年01月09日	16.15	22,600	364,990.00
132	600481	双良节能	2024年01月12日- 2024年01月12日	8.46	14,500	122,670.00
133	600499	科达制造	2024年01月09日- 2024年01月09日	10.55	20,200	213,110.00
134	600500	中化国际	2024年01月02日- 2024年01月02日	4.42	23,200	102,544.00
135	600516	方大炭素	2024年01月04日- 2024年01月04日	5.24	36,500	191,260.00
136	600536	中国软件	2024年01月09日- 2024年01月09日	36.26	7,800	282,828.00
137	600597	光明乳业	2024年01月12日- 2024年01月12日	8.73	8,900	77,697.00
138	600663	陆家嘴	2024年01月09日- 2024年01月09日	8.75	9,600	84,000.00
139	600673	东阳光	2024年01月12日- 2024年01月12日	7.33	23,400	171,522.00
140	600699	均胜电子	2024年01月09日- 2024年01月09日	17.96	12,700	228,092.00
141	600707	彩虹股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	6.75	18,600	125,550.00
142	600764	中国海防	2024年01月09日- 2024年01月09日	24.95	3,600	89,820.00
143	600801	华新水泥	2024年01月09日- 2024年01月09日	12.43	8,700	108,141.00
144	600839	四川长虹	2024年01月10日-	5.29	47,800	252,862.00

			2024年01月10日			
14 5	600871	石化油服	2024年01月09日- 2024年01月12日	1.83	52,700	96,441.00
14 6	600879	航天电子	2024年01月12日- 2024年01月12日	7.71	25,600	197,376.00
14 7	600884	杉杉股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	13.62	14,600	198,852.00
14 8	600895	张江高科	2024年01月09日- 2024年01月09日	19.30	10,000	193,000.00
14 9	600901	江苏金租	2024年01月10日- 2024年01月10日	4.84	21,900	105,996.00
15 0	600956	新天绿能	2024年01月09日- 2024年01月09日	8.13	4,500	36,585.00
15 1	600959	江苏有线	2024年01月09日- 2024年01月09日	3.14	38,800	121,832.00
15 2	600967	内蒙一机	2024年01月12日- 2024年01月12日	8.26	11,000	90,860.00
15 3	600968	海油发展	2024年01月02日- 2024年01月02日	2.85	26,300	74,955.00
15 4	600977	中国电影	2024年01月09日- 2024年01月09日	12.24	9,600	117,504.00
15 5	600985	淮北矿业	2024年01月09日- 2024年01月09日	16.63	12,800	212,864.00
15 6	600995	南网储能	2024年01月09日- 2024年01月09日	9.86	12,400	122,264.00
15 7	601016	节能风电	2024年01月09日- 2024年01月09日	3.00	50,300	150,900.00
15 8	601061	中信金属	2024年01月09日- 2024年01月09日	7.71	6,300	48,573.00
15 9	601098	中南传媒	2024年01月12日- 2024年01月12日	10.17	9,300	94,581.00
16 0	601139	深圳燃气	2024年01月09日-	6.89	7,400	50,986.00

			2024年01月09日			
16 1	601156	东航物流	2024年01月09日- 2024年01月09日	14.78	6,100	90,158.00
16 2	601168	西部矿业	2024年01月12日- 2024年01月12日	14.27	24,600	351,042.00
16 3	601216	君正集团	2024年01月09日- 2024年01月09日	3.74	43,700	163,438.00
16 4	601228	广州港	2024年01月02日- 2024年01月02日	3.13	19,500	61,035.00
16 5	601298	青岛港	2024年01月02日- 2024年01月02日	6.18	9,000	55,620.00
16 6	601456	国联证券	2024年01月09日- 2024年01月09日	10.84	15,400	166,936.00
16 7	601568	北元集团	2024年01月12日- 2024年01月12日	4.74	15,400	72,996.00
16 8	601598	中国外运	2024年01月12日- 2024年01月12日	5.24	20,400	106,896.00
16 9	601608	中信重工	2024年01月02日- 2024年01月02日	3.86	22,400	86,464.00
17 0	601636	旗滨集团	2024年01月09日- 2024年01月09日	6.84	20,800	142,272.00
17 1	601666	平煤股份	2024年01月10日- 2024年01月10日	11.56	10,000	115,600.00
17 2	601828	美凯龙	2024年01月02日- 2024年01月02日	3.87	14,000	54,180.00
17 3	601866	中远海发	2024年01月12日- 2024年01月12日	2.34	51,200	119,808.00
17 4	601928	凤凰传媒	2024年01月09日- 2024年01月09日	8.81	9,800	86,338.00
17 5	601933	永辉超市	2024年01月02日- 2024年01月02日	2.82	47,000	132,540.00
17 6	601958	金钼股份	2024年01月12日-	9.45	12,500	118,125.00

			2024年01月12日			
17 7	601966	玲珑轮胎	2024年01月12日- 2024年01月12日	19.23	9,500	182,685.00
17 8	601991	大唐发电	2024年01月02日- 2024年01月02日	2.42	48,100	116,402.00
17 9	601992	金隅集团	2024年01月09日- 2024年01月09日	1.91	54,000	103,140.00
18 0	603000	人民网	2024年01月09日- 2024年01月09日	27.98	7,100	198,658.00
18 1	603026	胜华新材	2024年01月12日- 2024年01月12日	45.86	2,000	91,720.00
18 2	603077	和邦生物	2024年01月09日- 2024年01月09日	2.36	80,000	188,800.00
18 3	603127	昭衍新药	2024年01月02日- 2024年01月02日	23.71	4,800	113,808.00
18 4	603156	养元饮品	2024年01月09日- 2024年01月09日	21.26	6,500	138,190.00
18 5	603185	弘元绿能	2024年01月09日- 2024年01月09日	33.28	3,700	123,136.00
18 6	603218	日月股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	12.37	6,600	81,642.00
18 7	603225	新凤鸣	2024年01月09日- 2024年01月09日	14.20	9,900	140,580.00
18 8	603317	天味食品	2024年01月02日- 2024年01月02日	13.29	4,100	54,489.00
18 9	603355	莱克电气	2024年01月12日- 2024年01月12日	22.30	1,400	31,220.00
19 0	603379	三美股份	2024年01月09日- 2024年01月09日	34.00	3,100	105,400.00
19 1	603529	爱玛科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	25.04	3,300	82,632.00
19 2	603596	伯特利	2024年01月09日-	69.30	3,900	270,270.00

			2024年01月09日			
19 3	603606	东方电缆	2024年01月12日- 2024年01月12日	42.75	5,300	226,575.00
19 4	603658	安图生物	2024年01月12日- 2024年01月12日	57.01	3,000	171,030.00
19 5	603688	石英股份	2024年01月12日- 2024年01月12日	86.88	2,300	199,824.00
19 6	603737	三棵树	2024年01月09日- 2024年01月09日	47.61	2,700	128,547.00
19 7	603816	顾家家居	2024年01月09日- 2024年01月09日	35.00	6,400	224,000.00
19 8	603826	坤彩科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	59.03	1,800	106,254.00
19 9	603866	桃李面包	2024年01月02日- 2024年01月02日	7.66	10,300	78,898.00
20 0	603939	益丰药房	2024年01月12日- 2024年01月12日	40.04	6,500	260,260.00
20 1	688002	睿创微纳	2024年01月12日- 2024年01月12日	44.22	3,000	132,660.00
20 2	688005	容百科技	2024年01月12日- 2024年01月12日	39.80	3,700	147,260.00
20 3	688295	中复神鹰	2024年01月12日- 2024年01月12日	30.31	1,600	48,496.00
20 4	688331	荣昌生物	2024年01月12日- 2024年01月12日	62.06	2,200	136,532.00
20 5	688387	信科移动	2024年01月09日- 2024年01月09日	7.21	8,800	63,448.00
20 6	688390	固德威	2024年01月09日- 2024年01月09日	130.58	1,500	195,870.00
20 7	688425	铁建重工	2024年01月09日- 2024年01月09日	3.97	20,700	82,179.00
20 8	688520	神州细胞	2024年01月09日-	53.87	1,700	91,579.00

			2024年01月09日			
209	688538	和辉光电	2024年01月12日- 2024年01月12日	2.43	53,800	130,734.00
210	688567	孚能科技	2024年01月09日- 2024年01月09日	16.31	9,400	153,314.00
211	688772	珠海冠宇	2024年01月12日- 2024年01月12日	22.01	8,700	191,487.00
合计					3,590,100	31,015,528.00

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、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。

7.4.13.2 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）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2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	11,890,313.00	-	-	-	11,890,313.00
交易性金融资产	-	-	-	208,436,801.82	208,436,801.82
应收申购款	-	-	-	27,159.18	27,159.18
其他资产	-	-	-	13,356.27	13,356.27
资产总计	11,890,313.00	-	-	208,477,317.27	220,367,630.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	304,300.34	304,300.34

应付管理人报酬	-	-	-	93,591.97	93,591.97
应付托管费	-	-	-	9,359.19	9,359.19
应付销售服务费	-	-	-	24,561.14	24,561.14
应交税费	-	-	-	2,044.44	2,044.44
其他负债	-	-	-	265,458.67	265,458.67
负债总计	-	-	-	699,315.75	699,315.75
利率敏感度缺口	11,890,313.00	-	-	207,778,001.52	219,668,314.52
上年度末 2022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	12,681,656.06	-	-	-	12,681,656.06
交易性金融资产	-	-	-	214,549,149.48	214,549,149.48
应收申购款	-	-	-	33,847.77	33,847.77
其他资产	-	-	-	5,767.69	5,767.69
资产总计	12,681,656.06	-	-	214,588,764.94	227,270,421.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	144,253.67	144,253.67

应付管理人报酬	-	-	-	96,640.27	96,640.27
应付托管费	-	-	-	9,664.04	9,664.04
应付销售服务费	-	-	-	21,263.10	21,263.10
应交税费	-	-	-	1,359.01	1,359.01
其他负债	-	-	-	265,412.84	265,412.84
负债总计	-	-	-	538,592.93	538,592.93
利率敏感度缺口	12,681,656.06	-	-	214,050,172.01	226,731,828.07

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。

7.4.13.4.1.2 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）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	208,436,801.82	94.89	214,549,149.48	94.63
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	208,436,801.82	94.89	214,549,149.48	94.63

7.4.13.4.3.2 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	10,894,681.70	11,262,967.59
	业绩比较基准下降5%	-10,894,681.70	-11,262,967.59

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	207,756,231.29	213,011,856.29
第二层次	-	811,107.00
第三层次	680,570.53	726,186.19
合计	208,436,801.82	214,549,149.48

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	726,186.19	726,186.19
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,154,156.87	1,154,156.87
转出第三层次	-	1,398,401.33	1,398,401.33
当期利得或损失总额	-	198,628.80	198,628.80
其中：计入损益的利得或损失	-	198,628.80	198,628.80
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	680,570.53	680,570.53
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	53,823.82	53,823.82
项目	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	1,295,146.07	1,295,146.07
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	690,919.32	690,919.32
转出第三层次	-	1,295,146.07	1,295,146.07
当期利得或损失总额	-	35,266.87	35,266.87
其中：计入损益的利得或损失	-	35,266.87	35,266.87
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	726,186.19	726,186.19
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	35,266.87	35,266.87

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	680,570.53	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1462-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	726,186.19	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022年12月31日：无）。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	208,436,801.82	94.59
	其中：股票	208,436,801.82	94.59
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	11,890,313.00	5.40
8	其他各项资产	40,515.45	0.02
9	合计	220,367,630.27	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为31,015,528.00元，占基金资产净值比例为14.12%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	1,406,772.00	0.64
B	采矿业	8,001,262.39	3.64
C	制造业	130,647,998.76	59.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,744,642.00	3.07
E	建筑业	1,651,905.00	0.75
F	批发和零售业	6,255,446.94	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	3,835,289.00	1.75

H	住宿和餐饮业	339,563.18	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,644,249.71	7.12
J	金融业	18,729,130.91	8.53
K	房地产业	2,585,910.00	1.18
L	租赁和商务服务业	1,841,543.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	1,898,618.84	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	1,100,296.00	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	570,384.00	0.26
Q	卫生和社会工作	1,564,523.00	0.71
R	文化、体育和娱乐业	2,961,004.00	1.35
S	综合	1,213,770.00	0.55
	合计	206,992,308.73	94.23

8.2.2 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	290.40	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	888,770.57	0.40
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	41,297.85	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,314.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,098.64	0.04
J	金融业	35.90	0.00

K	房地产业	379,099.04	0.17
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	20,736.40	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	15,792.29	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,444,493.09	0.66

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	300502	新易盛	23,000	1,134,360.00	0.52
2	002422	科伦药业	38,200	1,109,710.00	0.51
3	002028	思源电气	20,000	1,040,800.00	0.47
4	300418	昆仑万维	27,500	1,028,500.00	0.47
5	600157	永泰能源	719,600	985,852.00	0.45
6	000988	华工科技	32,600	970,176.00	0.44
7	002463	沪电股份	43,200	955,584.00	0.44
8	601058	赛轮轮胎	80,882	950,363.50	0.43
9	601555	东吴证券	129,760	948,545.60	0.43
10	000975	银泰黄金	62,900	943,500.00	0.43

11	600079	人福医药	37,000	919,820.00	0.42
12	600418	江淮汽车	56,600	914,090.00	0.42
13	002340	格林美	166,300	907,998.00	0.41
14	601168	西部矿业	61,700	880,459.00	0.40
15	000933	神火股份	51,000	856,800.00	0.39
16	301236	软通动力	18,500	854,700.00	0.39
17	601233	桐昆股份	54,700	827,611.00	0.38
18	600161	天坛生物	26,700	826,098.00	0.38
19	300394	天孚通信	9,000	823,680.00	0.37
20	601077	渝农商行	200,500	818,040.00	0.37
21	601108	财通证券	105,300	817,128.00	0.37
22	000630	铜陵有色	246,100	807,208.00	0.37
23	300037	新宙邦	17,040	805,992.00	0.37
24	002384	东山精密	44,300	805,374.00	0.37
25	002156	通富微电	34,300	793,016.00	0.36
26	000009	中国宝安	66,800	784,232.00	0.36
27	688122	西部超导	14,724	783,758.52	0.36
28	002517	恺英网络	69,700	778,549.00	0.35
29	300012	华测检测	54,500	773,900.00	0.35
30	002966	苏州银行	118,770	767,254.20	0.35
31	600109	国金证券	84,400	766,352.00	0.35
32	600988	赤峰黄金	53,839	754,284.39	0.34
33	600885	宏发股份	26,980	745,727.20	0.34
34	688169	石头科技	2,625	742,743.75	0.34
35	300136	信维通信	31,300	738,680.00	0.34
36	002465	海格通信	56,300	723,455.00	0.33
37	002625	光启技术	48,800	721,264.00	0.33
38	600160	巨化股份	43,700	720,613.00	0.33
39	000423	东阿阿胶	14,600	720,072.00	0.33
40	600765	中航重机	37,460	715,860.60	0.33
41	300207	欣旺达	48,200	711,432.00	0.32

42	600352	浙江龙盛	84,300	708,120.00	0.32
43	600536	中国软件	19,519	707,758.94	0.32
44	002185	华天科技	83,000	707,160.00	0.32
45	002138	顺络电子	26,100	704,961.00	0.32
46	688072	拓荆科技	3,030	700,839.00	0.32
47	002738	中矿资源	18,780	700,681.80	0.32
48	601162	天风证券	224,500	693,705.00	0.32
49	600298	安琪酵母	19,674	692,131.32	0.32
50	000932	华菱钢铁	134,200	691,130.00	0.31
51	300003	乐普医疗	42,600	688,416.00	0.31
52	603596	伯特利	9,800	679,140.00	0.31
53	688099	晶晨股份	10,785	675,464.55	0.31
54	000783	长江证券	125,400	674,652.00	0.31
55	002223	鱼跃医疗	19,500	674,310.00	0.31
56	300144	宋城演艺	67,900	670,173.00	0.31
57	300724	捷佳伟创	9,000	666,090.00	0.30
58	002439	启明星辰	24,500	661,500.00	0.30
59	002078	太阳纸业	54,300	660,831.00	0.30
60	603939	益丰药房	16,360	655,054.40	0.30
61	000723	美锦能源	98,100	653,346.00	0.30
62	600415	小商品城	88,800	650,016.00	0.30
63	600096	云天化	41,600	648,960.00	0.30
64	002739	万达电影	49,400	643,188.00	0.29
65	300568	星源材质	41,500	639,930.00	0.29
66	002385	大北农	107,200	638,912.00	0.29
67	600482	中国动力	35,400	637,554.00	0.29
68	600873	梅花生物	66,700	636,985.00	0.29
69	002756	永兴材料	12,200	636,962.00	0.29
70	000066	中国长城	62,700	634,524.00	0.29
71	002532	天山铝业	105,500	634,055.00	0.29
72	002797	第一创业	108,900	632,709.00	0.29

73	600839	四川长虹	119,600	632,684.00	0.29
74	300474	景嘉微	8,850	625,783.50	0.28
75	688180	君实生物	14,888	622,765.04	0.28
76	300017	网宿科技	78,900	619,365.00	0.28
77	603160	汇顶科技	8,900	614,990.00	0.28
78	300395	菲利华	16,800	614,208.00	0.28
79	002600	领益智造	90,800	613,808.00	0.28
80	600155	华创云信	73,200	610,488.00	0.28
81	002273	水晶光电	45,030	609,706.20	0.28
82	002044	美年健康	101,400	609,414.00	0.28
83	300285	国瓷材料	26,000	601,120.00	0.27
84	600862	中航高科	27,100	600,265.00	0.27
85	002294	信立泰	18,100	591,146.00	0.27
86	300601	康泰生物	21,700	589,155.00	0.27
87	600177	雅戈尔	89,900	588,845.00	0.27
88	600129	太极集团	12,600	585,396.00	0.27
89	300866	安克创新	6,600	584,760.00	0.27
90	600497	驰宏锌锗	115,400	582,770.00	0.27
91	688120	华海清科	3,088	579,617.60	0.26
92	000728	国元证券	84,800	579,184.00	0.26
93	688114	华大智造	6,729	578,828.58	0.26
94	300058	蓝色光标	80,600	578,708.00	0.26
95	600699	均胜电子	31,900	572,924.00	0.26
96	603606	东方电缆	13,400	572,850.00	0.26
97	002472	双环传动	22,000	572,440.00	0.26
98	601990	南京证券	71,600	571,368.00	0.26
99	600348	华阳股份	58,450	570,472.00	0.26
100	002607	中公教育	139,800	570,384.00	0.26
101	000831	中国稀土	20,600	570,002.00	0.26
102	600066	宇通客车	43,000	569,750.00	0.26
103	603882	金城医学	9,100	569,387.00	0.26

104	002195	岩山科技	185,400	569,178.00	0.26
105	601128	常熟银行	88,800	567,432.00	0.26
106	002008	大族激光	27,300	565,656.00	0.26
107	600546	山煤国际	32,100	562,071.00	0.26
108	300146	汤臣倍健	33,000	561,990.00	0.26
109	603816	顾家家居	16,000	560,000.00	0.25
110	002353	杰瑞股份	19,900	559,389.00	0.25
111	601696	中银证券	54,000	555,660.00	0.25
112	000893	亚钾国际	21,100	553,664.00	0.25
113	002673	西部证券	86,900	553,553.00	0.25
114	600529	山东药玻	21,500	550,400.00	0.25
115	688301	奕瑞科技	1,664	541,232.64	0.25
116	300604	长川科技	14,100	535,659.00	0.24
117	600985	淮北矿业	32,100	533,823.00	0.24
118	600499	科达制造	50,500	532,775.00	0.24
119	601577	长沙银行	78,100	532,642.00	0.24
120	300088	长信科技	79,500	531,855.00	0.24
121	002262	恩华药业	19,600	531,552.00	0.24
122	600060	海信视像	25,400	530,860.00	0.24
123	603589	口子窖	11,700	530,010.00	0.24
124	600369	西南证券	129,100	528,019.00	0.24
125	002444	巨星科技	23,400	526,968.00	0.24
126	000997	新大陆	26,700	523,587.00	0.24
127	002624	完美世界	44,000	520,960.00	0.24
128	300118	东方日升	29,500	520,675.00	0.24
129	601666	平煤股份	45,000	520,200.00	0.24
130	688728	格科微	25,260	517,072.20	0.24
131	601198	东兴证券	62,800	516,844.00	0.24
132	002409	雅克科技	9,200	512,716.00	0.23
133	603688	石英股份	5,900	512,592.00	0.23
134	688002	睿创微纳	11,586	512,332.92	0.23

135	688390	固德威	3,918	511,612.44	0.23
136	600642	申能股份	79,300	509,106.00	0.23
137	000400	许继电气	23,100	507,276.00	0.23
138	300699	光威复材	18,880	503,529.60	0.23
139	603000	人民网	17,900	500,842.00	0.23
140	300073	当升科技	13,100	500,420.00	0.23
141	002131	利欧股份	218,800	498,864.00	0.23
142	600486	扬农化工	7,900	498,648.00	0.23
143	600637	东方明珠	66,300	498,576.00	0.23
144	600884	杉杉股份	36,600	498,492.00	0.23
145	002558	巨人网络	44,700	497,958.00	0.23
146	000683	远兴能源	84,800	497,776.00	0.23
147	600399	抚顺特钢	51,100	496,692.00	0.23
148	600535	天士力	29,100	495,282.00	0.23
149	000878	云南铜业	45,400	494,406.00	0.23
150	000591	太阳能	88,600	494,388.00	0.23
151	600879	航天电子	64,100	494,211.00	0.22
152	000629	钒钛股份	150,500	493,640.00	0.22
153	600118	中国卫星	19,100	493,162.00	0.22
154	688188	柏楚电子	1,948	493,058.28	0.22
155	002152	广电运通	40,200	492,852.00	0.22
156	000021	深科技	30,300	491,163.00	0.22
157	600867	通化东宝	45,200	489,516.00	0.22
158	002497	雅化集团	37,300	488,257.00	0.22
159	601997	贵阳银行	94,700	486,758.00	0.22
160	688521	芯原股份	9,708	485,011.68	0.22
161	600895	张江高科	25,100	484,430.00	0.22
162	600143	金发科技	60,600	484,194.00	0.22
163	300390	天华新能	19,030	482,410.50	0.22
164	605358	立昂微	17,584	481,625.76	0.22
165	000998	隆平高科	34,100	480,810.00	0.22

166	300001	特锐德	23,900	480,390.00	0.22
167	688772	珠海冠宇	21,794	479,685.94	0.22
168	000703	恒逸石化	71,200	478,464.00	0.22
169	600516	方大炭素	91,300	478,412.00	0.22
170	300024	机器人	40,200	477,174.00	0.22
171	688220	翱捷科技	6,772	477,019.68	0.22
172	600416	湘电股份	30,000	476,400.00	0.22
173	002240	盛新锂能	20,900	475,475.00	0.22
174	002432	九安医疗	12,600	474,642.00	0.22
175	600549	厦门钨业	27,600	474,168.00	0.22
176	603712	七一二	15,000	472,650.00	0.22
177	603077	和邦生物	200,200	472,472.00	0.22
178	600170	上海建工	201,400	471,276.00	0.21
179	002407	多氟多	30,940	470,906.80	0.21
180	600153	建发股份	48,600	468,018.00	0.21
181	002430	杭氧股份	15,900	464,439.00	0.21
182	600392	盛和资源	45,400	462,172.00	0.21
183	688052	纳芯微	2,769	462,007.65	0.21
184	600141	兴发集团	25,200	459,900.00	0.21
185	601966	玲珑轮胎	23,900	459,597.00	0.21
186	000960	锡业股份	32,000	458,240.00	0.21
187	000039	中集集团	59,700	456,705.00	0.21
188	000623	吉林敖东	30,100	455,714.00	0.21
189	300383	光环新网	46,600	452,952.00	0.21
190	002065	东华软件	72,700	448,559.00	0.20
191	300748	金力永磁	22,180	448,479.60	0.20
192	600704	物产中大	100,900	446,987.00	0.20
193	600909	华安证券	91,240	445,251.20	0.20
194	600998	九州通	63,334	443,971.34	0.20
195	300212	易华录	14,100	443,445.00	0.20
196	601717	郑煤机	34,900	441,485.00	0.20

197	000750	国海证券	124,100	439,314.00	0.20
198	300487	蓝晓科技	8,200	435,092.00	0.20
199	603658	安图生物	7,600	433,276.00	0.20
200	002203	海亮股份	38,700	431,505.00	0.20
201	002064	华峰化学	64,300	431,453.00	0.20
202	002268	电科网安	19,200	431,232.00	0.20
203	600673	东阳光	58,600	429,538.00	0.20
204	002025	航天电器	8,900	427,378.00	0.19
205	600583	海油工程	71,600	425,304.00	0.19
206	600166	福田汽车	155,500	424,515.00	0.19
207	000738	航发控制	21,300	423,870.00	0.19
207	000050	深天马A	39,800	423,870.00	0.19
209	603456	九洲药业	17,500	423,675.00	0.19
210	600521	华海药业	28,800	422,496.00	0.19
211	300114	中航电测	9,600	420,000.00	0.19
212	603338	浙江鼎力	8,200	419,594.00	0.19
213	601456	国联证券	38,700	419,508.00	0.19
214	002939	长城证券	52,300	418,400.00	0.19
215	002568	百润股份	17,000	418,370.00	0.19
216	002368	太极股份	14,165	418,292.45	0.19
217	300558	贝达药业	8,100	417,555.00	0.19
218	000513	丽珠集团	11,900	416,619.00	0.19
219	002299	圣农发展	24,200	415,756.00	0.19
220	600398	海澜之家	56,000	415,520.00	0.19
221	002506	协鑫集成	151,600	415,384.00	0.19
222	689009	九号公司	14,001	415,269.66	0.19
223	002128	电投能源	29,000	413,830.00	0.19
224	600863	内蒙华电	105,700	412,230.00	0.19
225	600820	隧道股份	71,300	410,688.00	0.19
226	600859	王府井	25,700	410,429.00	0.19
227	000636	风华高科	30,000	409,800.00	0.19

228	002092	中泰化学	67,100	409,310.00	0.19
229	002429	兆驰股份	73,300	409,014.00	0.19
230	601216	君正集团	109,300	408,782.00	0.19
231	600739	辽宁成大	34,700	408,766.00	0.19
232	600563	法拉电子	4,400	407,440.00	0.19
233	002414	高德红外	55,300	403,690.00	0.18
234	002373	千方科技	35,800	401,318.00	0.18
235	300253	卫宁健康	55,600	399,764.00	0.18
236	600435	北方导航	34,000	399,160.00	0.18
237	002926	华西证券	51,000	395,760.00	0.18
238	000729	燕京啤酒	45,600	393,528.00	0.18
239	300296	利亚德	65,500	393,000.00	0.18
240	300595	欧普康视	17,400	392,892.00	0.18
241	600655	豫园股份	63,100	391,851.00	0.18
242	300009	安科生物	38,040	388,768.80	0.18
243	300251	光线传媒	47,500	387,125.00	0.18
244	002595	豪迈科技	13,000	387,010.00	0.18
245	688567	孚能科技	23,667	386,008.77	0.18
246	600021	上海电力	45,600	385,776.00	0.18
247	600325	华发股份	53,500	385,735.00	0.18
248	300244	迪安诊断	16,200	385,722.00	0.18
249	300373	扬杰科技	10,500	385,350.00	0.18
250	300676	华大基因	8,000	384,000.00	0.17
251	600008	首创环保	142,600	383,594.00	0.17
252	600271	航天信息	36,000	383,040.00	0.17
253	600498	烽火通信	23,000	382,720.00	0.17
254	000519	中兵红箭	27,100	380,484.00	0.17
255	601016	节能风电	125,810	377,430.00	0.17
256	002500	山西证券	69,800	376,222.00	0.17
257	688536	思瑞浦	2,570	375,991.00	0.17
258	600380	健康元	30,200	375,386.00	0.17

259	600004	白云机场	38,300	374,574.00	0.17
260	688005	容百科技	9,408	374,438.40	0.17
261	002507	涪陵榨菜	26,180	374,112.20	0.17
262	600566	济川药业	11,900	374,017.00	0.17
263	002372	伟星新材	25,800	373,326.00	0.17
264	000830	鲁西化工	37,200	373,116.00	0.17
265	002850	科达利	4,400	371,624.00	0.17
266	600282	南钢股份	99,800	369,260.00	0.17
267	002936	郑州银行	183,179	368,189.79	0.17
268	688234	天岳先进	5,565	367,679.55	0.17
269	002281	光迅科技	12,900	367,650.00	0.17
270	603233	大参林	14,720	366,528.00	0.17
271	600038	中直股份	9,500	366,035.00	0.17
272	000060	中金岭南	84,700	365,904.00	0.17
273	688032	禾迈股份	1,349	364,230.00	0.17
274	002192	融捷股份	6,700	363,207.00	0.17
275	688063	派能科技	3,412	361,672.00	0.16
276	601636	旗滨集团	52,100	356,364.00	0.16
277	688331	荣昌生物	5,742	356,348.52	0.16
278	002056	横店东磁	26,300	356,102.00	0.16
279	601880	辽港股份	243,900	353,655.00	0.16
280	603225	新凤鸣	24,800	352,160.00	0.16
281	002019	亿帆医药	23,800	351,764.00	0.16
282	300070	碧水源	70,400	351,296.00	0.16
283	002670	国盛金控	37,600	350,432.00	0.16
284	002120	韵达股份	46,900	349,874.00	0.16
285	600511	国药股份	12,200	349,164.00	0.16
286	603156	养元饮品	16,422	349,131.72	0.16
287	300682	朗新科技	21,300	349,107.00	0.16
288	300529	健帆生物	15,700	349,011.00	0.16
289	600580	卧龙电驱	29,700	348,381.00	0.16

290	300677	英科医疗	14,840	346,662.40	0.16
291	000547	航天发展	41,400	346,518.00	0.16
292	002080	中材科技	21,700	345,464.00	0.16
293	603927	中科软	11,520	345,369.60	0.16
294	002557	洽洽食品	9,900	344,718.00	0.16
295	603885	吉祥航空	28,700	344,400.00	0.16
296	603444	吉比特	1,400	343,168.00	0.16
297	603893	瑞芯微	5,400	342,360.00	0.16
298	002865	钧达股份	4,400	340,912.00	0.16
299	600390	五矿资本	72,800	340,704.00	0.16
300	600258	首旅酒店	21,739	339,563.18	0.15
301	002531	天顺风能	29,100	337,560.00	0.15
302	601000	唐山港	96,000	336,000.00	0.15
303	002508	老板电器	15,400	335,412.00	0.15
304	688385	复旦微电	8,618	332,913.34	0.15
305	002831	裕同科技	12,100	332,871.00	0.15
306	601933	永辉超市	117,600	331,632.00	0.15
307	688200	华峰测控	2,698	331,314.40	0.15
308	603517	绝味食品	12,300	330,378.00	0.15
309	002572	索菲亚	20,700	330,165.00	0.15
310	002487	大金重工	12,400	330,088.00	0.15
311	000598	兴蓉环境	58,000	330,020.00	0.15
312	300026	红日药业	77,800	329,872.00	0.15
313	002958	青农商行	125,900	329,858.00	0.15
314	601179	中国西电	66,400	327,352.00	0.15
315	688538	和辉光电	134,596	327,068.28	0.15
316	000970	中科三环	31,520	326,232.00	0.15
317	601231	环旭电子	21,500	324,865.00	0.15
318	601778	晶科科技	92,500	323,750.00	0.15
319	603737	三棵树	6,800	323,748.00	0.15
320	300438	鹏辉能源	11,400	322,506.00	0.15

321	688516	奥特维	3,544	320,732.00	0.15
322	600970	中材国际	34,200	319,428.00	0.15
323	000155	川能动力	23,900	317,631.00	0.14
324	000887	中鼎股份	25,600	316,672.00	0.14
325	600906	财达证券	42,000	315,000.00	0.14
326	600707	彩虹股份	46,500	313,875.00	0.14
327	603185	弘元绿能	9,400	312,832.00	0.14
328	600848	上海临港	31,000	311,550.00	0.14
329	600329	达仁堂	9,200	309,580.00	0.14
330	002030	达安基因	31,840	308,211.20	0.14
331	600481	双良节能	36,400	307,944.00	0.14
332	600995	南网储能	31,100	306,646.00	0.14
333	600959	江苏有线	97,200	305,208.00	0.14
334	603858	步长制药	17,900	304,479.00	0.14
335	002155	湖南黄金	27,300	304,122.00	0.14
336	688082	盛美上海	2,893	302,058.13	0.14
337	000563	陕国投A	99,343	302,002.72	0.14
338	688029	南微医学	3,117	301,725.60	0.14
339	601866	中远海发	128,200	299,988.00	0.14
340	600208	新湖中宝	137,800	299,026.00	0.14
341	600755	厦门国贸	42,800	298,316.00	0.14
342	000027	深圳能源	46,200	297,990.00	0.14
343	600977	中国电影	24,200	296,208.00	0.13
344	000778	新兴铸管	77,500	296,050.00	0.13
345	300357	我武生物	10,206	295,974.00	0.13
346	601958	金钼股份	31,300	295,785.00	0.13
347	600131	国网信通	19,500	295,425.00	0.13
348	600316	洪都航空	13,900	294,263.00	0.13
349	000739	普洛药业	19,100	293,949.00	0.13
350	000987	越秀资本	48,740	293,414.80	0.13
351	002244	滨江集团	40,300	292,981.00	0.13

352	600582	天地科技	53,600	291,584.00	0.13
353	601991	大唐发电	120,400	291,368.00	0.13
354	002683	广东宏大	14,500	291,160.00	0.13
355	601665	齐鲁银行	74,200	290,122.00	0.13
356	603127	昭衍新药	12,236	290,115.56	0.13
357	002266	浙富控股	84,900	288,660.00	0.13
358	600373	中文传媒	21,900	288,642.00	0.13
359	300888	稳健医疗	7,740	288,315.00	0.13
360	000709	河钢股份	133,960	285,334.80	0.13
361	600737	中粮糖业	34,600	285,104.00	0.13
362	603883	老百姓	9,520	284,552.80	0.13
363	000825	太钢不锈	74,100	276,393.00	0.13
364	002032	苏泊尔	5,200	275,652.00	0.13
365	002326	永太科技	23,700	275,394.00	0.13
366	600598	北大荒	23,000	275,310.00	0.13
367	600378	昊华科技	8,900	271,272.00	0.12
368	600801	华新水泥	21,800	270,974.00	0.12
369	601611	中国核建	39,100	270,963.00	0.12
370	600056	中国医药	24,220	270,537.40	0.12
371	000785	居然之家	81,400	268,620.00	0.12
372	603379	三美股份	7,900	268,600.00	0.12
373	000883	湖北能源	63,400	268,182.00	0.12
374	600528	中铁工业	36,000	267,840.00	0.12
375	601598	中国外运	51,100	267,764.00	0.12
376	300363	博腾股份	10,600	266,590.00	0.12
377	600901	江苏金租	55,040	266,393.60	0.12
378	603267	鸿远电子	5,300	266,060.00	0.12
379	603826	坤彩科技	4,500	265,635.00	0.12
380	600517	国网英大	55,600	265,212.00	0.12
381	603568	伟明环保	16,540	264,640.00	0.12
382	300776	帝尔激光	4,380	263,938.80	0.12

383	603650	彤程新材	7,800	259,740.00	0.12
384	002511	中顺洁柔	25,900	259,000.00	0.12
385	002153	石基信息	26,544	258,538.56	0.12
386	003035	南网能源	49,100	258,266.00	0.12
387	601992	金隅集团	135,000	257,850.00	0.12
388	600500	中化国际	58,100	256,802.00	0.12
389	601106	中国一重	88,800	255,744.00	0.12
390	600062	华润双鹤	13,500	251,100.00	0.11
391	002653	海思科	10,800	250,020.00	0.11
392	600827	百联股份	26,000	246,740.00	0.11
393	603228	景旺电子	10,900	245,904.00	0.11
394	000937	冀中能源	34,300	244,902.00	0.11
395	002408	齐翔腾达	46,040	243,091.20	0.11
396	603026	胜华新材	5,300	243,058.00	0.11
397	000581	威孚高科	16,100	242,627.00	0.11
398	600871	石化油服	131,800	241,194.00	0.11
399	001227	兰州银行	92,200	239,720.00	0.11
400	603305	旭升集团	12,100	238,733.00	0.11
401	003022	联泓新科	13,000	238,030.00	0.11
402	600022	山东钢铁	173,200	237,284.00	0.11
403	601098	中南传媒	23,300	236,961.00	0.11
404	603707	健友股份	15,669	235,035.00	0.11
405	601118	海南橡胶	55,400	234,896.00	0.11
406	600315	上海家化	11,000	232,980.00	0.11
407	600126	杭钢股份	43,700	232,921.00	0.11
408	600764	中国海防	9,200	229,540.00	0.10
409	688520	神州细胞	4,257	229,324.59	0.10
410	688779	长远锂科	31,232	227,993.60	0.10
411	600967	内蒙一机	27,600	227,976.00	0.10
412	601156	东航物流	15,400	227,612.00	0.10
413	002690	美亚光电	11,410	224,092.40	0.10

414	688349	三一重能	7,806	223,407.72	0.10
415	000559	万向钱潮	42,800	222,132.00	0.10
416	000156	华数传媒	30,000	221,100.00	0.10
417	000401	冀东水泥	34,400	219,816.00	0.10
418	601928	凤凰传媒	24,700	217,607.00	0.10
419	601608	中信重工	56,200	216,932.00	0.10
420	601187	厦门银行	42,700	216,489.00	0.10
421	688778	厦钨新能	5,449	215,998.36	0.10
422	688276	百克生物	3,932	215,512.92	0.10
423	002867	周大生	14,150	214,797.00	0.10
424	000089	深圳机场	33,200	213,476.00	0.10
425	600808	马钢股份	77,900	211,888.00	0.10
426	603529	爱玛科技	8,400	210,336.00	0.10
427	600663	陆家嘴	24,000	210,000.00	0.10
428	002518	科士达	7,600	209,760.00	0.10
429	600095	湘财股份	27,800	208,778.00	0.10
430	688208	道通科技	8,778	208,477.50	0.09
431	002010	传化智联	45,100	208,362.00	0.09
432	001286	陕西能源	24,300	207,765.00	0.09
433	603218	日月股份	16,700	206,579.00	0.09
434	300861	美畅股份	6,200	206,398.00	0.09
435	000958	电投产融	52,300	206,062.00	0.09
436	688425	铁建重工	51,806	205,669.82	0.09
437	300257	开山股份	12,900	203,304.00	0.09
438	000930	中粮科技	30,200	200,528.00	0.09
439	002423	中粮资本	29,800	199,064.00	0.09
440	603866	桃李面包	25,898	198,378.68	0.09
441	002505	鹏都农牧	123,900	198,240.00	0.09
442	002925	盈趣科技	10,100	196,647.00	0.09
443	000967	盈峰环境	41,200	195,700.00	0.09
444	600597	光明乳业	22,300	194,679.00	0.09

445	000898	鞍钢股份	77,600	193,224.00	0.09
446	002468	申通快递	24,800	193,192.00	0.09
447	688107	安路科技	5,191	190,924.98	0.09
448	688281	华秦科技	1,392	188,838.72	0.09
449	600968	海油发展	65,800	187,530.00	0.09
450	603786	科博达	2,600	185,536.00	0.08
451	003031	中瓷电子	2,100	185,283.00	0.08
452	300850	新强联	5,800	184,614.00	0.08
453	688006	杭可科技	7,818	183,566.64	0.08
454	601568	北元集团	38,560	182,774.40	0.08
455	002761	浙江建投	17,500	179,550.00	0.08
456	688690	纳微科技	6,537	179,244.54	0.08
457	688348	昱能科技	1,451	177,573.38	0.08
458	000959	首钢股份	50,500	174,730.00	0.08
459	000537	中绿电	18,100	174,303.00	0.08
460	002791	坚朗五金	4,200	170,058.00	0.08
461	600167	联美控股	29,600	167,832.00	0.08
462	688297	中无人机	4,371	167,540.43	0.08
463	600377	宁沪高速	16,100	165,025.00	0.08
464	600339	中油工程	54,200	164,226.00	0.07
465	001914	招商积余	13,700	163,852.00	0.07
466	002608	江苏国信	24,500	160,965.00	0.07
467	688387	信科移动	22,138	159,614.98	0.07
468	601228	广州港	48,900	153,057.00	0.07
469	600350	山东高速	21,900	151,986.00	0.07
470	002563	森马服饰	26,200	151,174.00	0.07
471	001203	大中矿业	14,700	149,499.00	0.07
472	600927	永安期货	9,400	147,674.00	0.07
473	603056	德邦股份	10,000	144,700.00	0.07
474	301029	怡合达	5,600	144,368.00	0.07
475	600928	西安银行	43,200	143,856.00	0.07

476	002399	海普瑞	12,100	141,933.00	0.06
477	000539	粤电力A	28,800	140,832.00	0.06
478	000402	金融街	38,700	140,481.00	0.06
479	601298	青岛港	22,700	140,286.00	0.06
480	603317	天味食品	10,308	136,993.32	0.06
481	601828	美凯龙	35,100	135,837.00	0.06
482	600925	苏能股份	24,500	134,995.00	0.06
483	688153	唯捷创芯	2,031	133,030.50	0.06
484	002945	华林证券	8,700	131,370.00	0.06
485	601139	深圳燃气	18,600	128,154.00	0.06
486	688295	中复神鹰	4,080	123,664.80	0.06
487	000031	大悦城	41,600	123,552.00	0.06
488	601061	中信金属	15,900	122,589.00	0.06
489	688105	诺唯赞	3,803	121,772.06	0.06
490	688819	天能股份	4,337	121,089.04	0.06
491	001872	招商港口	7,500	119,700.00	0.05
492	601158	重庆水务	18,700	106,029.00	0.05
493	600299	安迪苏	13,000	104,000.00	0.05
494	000553	安道麦A	14,100	97,854.00	0.04
495	688375	国博电子	1,166	92,731.98	0.04
496	600956	新天绿能	11,400	92,682.00	0.04
497	603355	莱克电气	3,680	82,064.00	0.04
498	603868	飞科电器	1,600	80,800.00	0.04
499	688248	南网科技	2,826	70,565.22	0.03
500	600032	浙江新能	7,000	56,420.00	0.03

8.3.2 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	000656	金科股份	145,500	263,355.00	0.12
2	002146	荣盛发展	67,600	115,596.00	0.05
3	688237	超卓航科	2,402	90,747.56	0.04
4	301292	海科新源	4,115	80,180.70	0.04
5	301486	致尚科技	1,665	79,689.89	0.04
6	688171	纬德信息	2,821	63,472.50	0.03
7	301487	盟固利	867	35,512.32	0.02
8	301348	蓝箭电子	421	18,763.97	0.01
9	301015	百洋医药	462	16,567.32	0.01
10	301421	波长光电	253	15,020.61	0.01
11	301510	固高科技	396	13,863.96	0.01
12	301381	赛维时代	457	13,568.33	0.01
13	300953	震裕科技	240	13,243.20	0.01
14	688627	精智达	149	13,070.28	0.01
15	301566	N达利	576	12,752.64	0.01
16	301172	君逸数码	331	12,630.96	0.01
17	688548	广钢气体	918	11,704.50	0.01
18	301558	三态股份	833	11,162.20	0.01
19	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
20	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
21	688563	航材股份	170	10,283.30	0.00
22	688582	芯动联科	263	10,170.21	0.00
23	688652	京仪装备	188	9,823.00	0.00
24	688603	天承科技	129	9,564.06	0.00
25	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
26	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
27	301372	科净源	213	9,284.67	0.00
28	301291	明阳电气	321	9,103.56	0.00
29	688610	埃科光电	176	8,976.00	0.00
30	688591	泰凌微	318	8,910.36	0.00
31	301048	金鹰重工	843	8,885.22	0.00

32	301508	中机认检	333	8,884.44	0.00
33	301429	森泰股份	411	8,400.84	0.00
34	688653	康希通信	516	8,250.84	0.00
35	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
36	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
37	301362	民爆光电	210	8,089.20	0.00
38	688651	盛邦安全	175	8,058.75	0.00
39	301507	民生健康	505	8,004.25	0.00
40	301272	英华特	149	7,953.62	0.00
41	301578	C辰奕	115	7,856.80	0.00
42	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
43	301210	金杨股份	168	7,640.64	0.00
44	301261	恒工精密	150	7,627.50	0.00
45	301468	博盈特焊	250	7,555.00	0.00
46	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
47	301469	恒达新材	224	7,412.16	0.00
48	301489	思泉新材	115	7,372.65	0.00
49	301568	思泰克	206	7,329.48	0.00
50	301329	信音电子	327	7,269.21	0.00
51	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
52	301251	威尔高	209	7,229.31	0.00
53	301459	丰茂股份	179	7,131.36	0.00
54	301202	朗威股份	221	7,027.80	0.00
55	301511	德福科技	309	7,005.03	0.00
56	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
57	301517	陕西华达	157	6,859.33	0.00
58	601096	宏盛华源	1,688	6,853.28	0.00
59	301395	仁信新材	360	6,728.40	0.00
60	688638	誉辰智能	111	6,624.48	0.00
61	301518	长华化学	284	6,534.84	0.00
62	301519	舜禹股份	322	6,507.62	0.00

63	301418	协昌科技	129	6,475.80	0.00
64	301528	多浦乐	92	6,339.72	0.00
65	688716	中研股份	174	6,331.86	0.00
66	301550	斯菱股份	142	6,186.94	0.00
67	301393	昊帆生物	104	6,174.48	0.00
68	300971	博亚精工	245	6,100.50	0.00
69	301016	雷尔伟	275	6,066.50	0.00
70	603605	珀莱雅	60	5,964.00	0.00
71	301456	盘古智能	196	5,956.44	0.00
72	688693	锆威特	136	5,903.76	0.00
73	688602	康鹏科技	530	5,861.80	0.00
74	688719	爱科赛博	97	5,829.70	0.00
75	301529	福赛科技	151	5,719.88	0.00
76	301525	儒竞科技	65	5,294.90	0.00
77	301500	飞南资源	252	5,264.28	0.00
78	301007	德迈仕	303	5,123.73	0.00
79	688646	逸飞激光	142	5,121.94	0.00
80	301559	中集环科	275	5,016.00	0.00
81	301520	万邦医药	93	4,904.82	0.00
82	688612	威迈斯	125	4,746.25	0.00
83	301033	迈普医学	108	4,702.32	0.00
84	001378	德冠新材	150	4,690.50	0.00
85	301371	敷尔佳	124	4,659.92	0.00
86	688657	浩辰软件	58	4,537.34	0.00
87	301548	崇德科技	75	4,424.25	0.00
88	001326	联域股份	88	4,280.32	0.00
89	601083	锦江航运	360	3,985.20	0.00
90	688450	光格科技	108	3,933.36	0.00
91	603004	C鼎龙	121	3,773.99	0.00
92	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
93	301057	汇隆新材	218	3,662.40	0.00

94	300763	锦浪科技	50	3,495.00	0.00
95	603270	金帝股份	117	3,460.86	0.00
96	001306	夏厦精密	45	3,391.20	0.00
97	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
98	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
99	001358	兴欣新材	68	3,002.88	0.00
100	603119	浙江荣泰	125	2,983.75	0.00
101	603107	上海汽配	157	2,855.83	0.00
102	603062	麦加芯彩	49	2,832.69	0.00
103	603275	众辰科技	71	2,818.70	0.00
104	603193	润本股份	153	2,548.98	0.00
105	603276	恒兴新材	102	2,537.76	0.00
106	603613	国联股份	109	2,399.09	0.00
107	603231	索宝蛋白	100	2,153.00	0.00
108	603075	热威股份	91	2,121.21	0.00
109	002603	以岭药业	55	1,268.85	0.00
110	600717	天津港	80	328.80	0.00
111	002124	天邦食品	80	290.40	0.00
112	600064	南京高科	23	138.92	0.00
113	000990	诚志股份	6	49.26	0.00
114	600120	浙江东方	10	35.90	0.00
115	600522	中天科技	1	12.49	0.00
116	600376	首开股份	3	9.12	0.00
117	400174	中天3	154,400	-	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300502	新易盛	1,180,520.00	0.52
2	002463	沪电股份	984,036.00	0.43
3	000066	中国长城	955,750.00	0.42
4	600372	中航机载	937,695.00	0.41
5	688122	西部超导	878,514.34	0.39
6	000423	东阿阿胶	852,786.00	0.38
7	002517	恺英网络	845,446.00	0.37
8	688072	拓荆科技	827,791.66	0.37
9	000933	神火股份	806,208.00	0.36
10	300394	天孚通信	788,473.00	0.35
11	300395	菲利华	774,671.00	0.34
12	002240	盛新锂能	766,961.00	0.34
13	603882	金域医学	745,428.00	0.33
14	301236	软通动力	736,778.00	0.32
15	002008	大族激光	734,249.00	0.32
16	688169	石头科技	719,809.20	0.32
17	300207	欣旺达	712,938.00	0.31
18	000723	美锦能源	699,135.00	0.31
19	300601	康泰生物	697,058.00	0.31
20	688120	华海清科	672,234.68	0.30

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。

8.4.2 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	300308	中际旭创	2,587,579.00	1.14
2	688256	寒武纪	1,247,276.18	0.55
3	600489	中金黄金	1,243,534.00	0.55
4	600372	中航机载	1,142,262.00	0.50

5	603345	安井食品	1,010,177.00	0.45
6	000807	云铝股份	1,004,887.00	0.44
7	600487	亨通光电	984,716.00	0.43
8	688122	西部超导	969,424.07	0.43
9	601607	上海医药	928,767.00	0.41
10	603605	珀莱雅	914,572.00	0.40
11	688777	中控技术	896,345.56	0.40
12	000999	华润三九	890,116.00	0.39
13	300832	新产业	865,449.60	0.38
14	002603	以岭药业	833,001.00	0.37
15	601699	潞安环能	764,618.00	0.34
16	603606	东方电缆	764,508.00	0.34
17	600705	中航产融	725,248.00	0.32
18	603613	国联股份	724,348.00	0.32
19	601872	招商轮船	720,094.00	0.32
20	300168	万达信息	707,884.00	0.31

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。

8.4.3 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	108,126,362.34
卖出股票收入（成交）总额	104,369,312.50

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,159.18
6	其他应收款	13,356.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,515.45

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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	300502	新易盛	453,744.00	0.21	转融通证券出借
2	002028	思源电气	416,320.00	0.19	转融通证券出借
3	300418	昆仑万维	411,400.00	0.19	转融通证券出借
4	600157	永泰能源	394,149.00	0.18	转融通证券出借
5	000988	华工科技	386,880.00	0.18	转融通证券出借
6	002463	沪电股份	380,464.00	0.17	转融通证券出借
7	000975	银泰黄金	376,500.00	0.17	转融通证券出借

8.12.5.2 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	301292	海科新源	7,972.20	0.00	创业板新股限售
2	301486	致尚科技	7,890.75	0.00	创业板新股限售

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息**9.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人 户 数 (户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
东财 中证5 00A	8,9 22	17,246.65	17,718,461.37	11.5 1%	136,156,148.25	88.49%
东财 中证5 00C	4,9 64	15,327.54	19,741,387.82	25.9 5%	56,344,540.40	74.05%
合计	13, 250	17,355.51	37,459,849.19	16.2 9%	192,500,688.65	83.71%

9.2 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	东财中证500 A	24,288.65	0.02%
	东财中证500 C	46.10	0.00%
	合计	24,334.75	0.01%

9.3 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	东财中证500A	0~10
	东财中证500C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	东财中证500A	0
	东财中证500C	0
	合计	0

9.4 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	10,899,819.83	4.74%	10,000,458.38	4.35%	3年
基金管理人高级管理人员	24,251.45	0.01%	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	6,534,957.42	2.84%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	17,459,028.70	7.59%	10,000,458.38	4.35%	3年

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	东财中证500A	东财中证500C
基金合同生效日(2021年01月20日)基金份额总额	266,643,478.48	138,576,371.83
本报告期期初基金份额总额	161,533,776.86	67,246,214.95
本报告期基金总申购份额	31,834,249.08	49,009,129.82
减：本报告期基金总赎回份额	39,493,416.32	40,169,416.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	153,874,609.62	76,085,928.22

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：报告期内基金管理人无重大人事变动。

基金托管人：报告期内，不涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金合同生效日起至本报告期末，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。本报告期内应支付审计费24,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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未受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	4	200,735,538.23	100.00%	189,424.80	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。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	西藏东财基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	证监会规定网站及报刊	2023-01-10
2	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2022年第4季度报告	证监会规定网站	2023-01-20
3	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	2023-01-31
4	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2022年年度报告	证监会规定网站	2023-03-29
5	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2023年第1季度报告	证监会规定网站	2023-04-21
6	西藏东财基金管理有限公司关于西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金所持停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定网站及报刊	2023-06-27
7	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与深圳市前海排排网基金销售有限责任公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定网站及报刊	2023-07-01
8	西藏东财中证500指数型发	证监会规定网站	2023-07-21

	起式证券投资基金2023年第2季度报告		
9	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与贵州省贵文文化基金销售有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定网站及报刊	2023-08-04
10	关于公司股东拟申购公司旗下权益类公募基金一亿元的公告	证监会规定网站及报刊	2023-08-22
11	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2023年中期报告	证监会规定网站	2023-08-30
12	西藏东财基金管理有限公司澄清公告	证监会规定网站及报刊	2023-09-07
13	西藏东财基金管理有限公司关于旗下基金参与上海好买基金销售有限公司认购、申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	证监会规定网站及报刊	2023-10-20
14	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金2023年第3季度报告	证监会规定网站	2023-10-25
15	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书更新	证监会规定网站	2023-12-21
16	西藏东财中证500指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2023-12-21

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予西藏东财中证500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500指数型发起式证券投资基金基金合同》
- 三、《西藏东财中证500指数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

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

13.3 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
二〇二四年三月三十日