

东财中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:东财基金管理有限公司

基金托管人:国信证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	64
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	64
§8 基金份额持有人信息.....	66

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§9 开放式基金份额变动	66
§10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	68
10.8 其他重大事件	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息	70
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	A500ETF东财
场内简称	A500ETF东财
基金主代码	159380
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年12月30日
基金管理人	东财基金管理有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	109,804,337.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025年01月08日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 但在因特殊情形导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 特殊情形包括但不限于：1、法律法规的限制；2、标的指数成份股流动性严重不足；3、标的指数的成份股长期停牌；4、标的指数成份股进行配股、增发或被

	吸收合并；5、标的指数成份股派发现金股息；6、指数成份股定期或临时调整；7、标的指数编制方法发生变化；8、其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。
业绩比较基准	中证A500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东财基金管理有限公司	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾勇	薛璐
	联系电话	021-23526999	0755-22940163
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		400-9210-107	0755-61897778
传真		021-23526940	0755-22940165
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼2层01室	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码		200030	518000
法定代表人		戴彦	张纳沙

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金中期报告置备地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日 - 2026年06月30日)
本期已实现收益	54,910,040.58
本期利润	29,788,124.74
加权平均基金份额本期利润	0.1910
本期加权平均净值利润率	13.86%
本期基金份额净值增长率	13.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)
期末可供分配利润	53,452,909.78
期末可供分配基金份额利润	0.4868
期末基金资产净值	163,454,593.97
期末基金份额净值	1.4886
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)
基金份额累计净值增长率	48.86%

- 注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	15.57%	1.38%	14.26%	1.41%	1.31%	-0.03%
过去六个月	13.63%	1.27%	11.91%	1.29%	1.72%	-0.02%
过去一年	40.49%	1.13%	36.38%	1.14%	4.11%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	48.86%	1.10%	34.56%	1.13%	14.30%	-0.03%

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



注：1、本基金基金合同于2024年12月30日生效。

2、本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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2026年6月30日，公司旗下管理62只证券投资基金--东财上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、东财量化精选混合型发起式证券投资基金、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、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、东财中证银行指数型发起式证券投资基金、东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金、东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金、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、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金、东财中证食品饮料指数增强型发起式证券投资基金、东财中证新能源指数增强型证券投资基金、东财数字经济优选混合型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、东财稳健配置六个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、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、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、东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞利债券型证券投资基金、东财中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、东财慧心优选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金、东财中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、东财卓越成长混合型发起式证券投资基金、东财景气驱动混合型发起式证券投资基金、东财中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金、东财北证50成份指数型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证50交易型开放式指数证券投资基金、东财中证1-3年国债交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金、东财

中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、东财30天滚动持有债券型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金、东财创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财启和混合型证券投资基金、东财北证50成份指数增强型发起式证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞兴债券型证券投资基金、东财新兴产业锐选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板100指数型证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金、东财中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
吴逸	本基金基金经理	2024-12-30	-	16年	上海财经大学金融数学与金融工程硕士。曾任天治基金管理有限公司产品创新及量化投资部总监助理、东财基金管理有限公司筹备组量化投资负责人、东财基金管理有限公司研究部总监，现任东财基金管理有限公司总经理助理、量化投资部总监、指数投资部总监、基金经理。
姚楠燕	本基金基金经理	2024-12-30	2026-02-04	9年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。曾任中欧国际工商学院金融学/会计学研究助理、东财基金管理有限公司筹备组成员，现任东财

					基金管理有限公司基金经 理兼基金经理助理。
姚楠燕	本基金基金经理助 理	2026- 02-04	-	9年	美国南加利福尼亚大学公 共政策硕士。曾任中欧国际 工商学院金融学/会计学研 究助理、东财基金管理有限 公司筹备组成员，现任东财 基金管理有限公司基金经 理兼基金经理助理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证A500指数，该指数从各行业选取市值较大、流动性较好的500只证券作为指数样本，以反映各行业最具代表性上市公司证券的整体表现。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，A500ETF东财份额净值为1.4886元，报告期内基金份额净值增长率为13.63%，同期业绩比较基准收益率为11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年，中国经济延续平稳向新态势，GDP同比增长4.7%，二季度名义GDP增速回升至5.9%，GDP平减指数三年来首次转正；CPI同比上涨1.0%，PPI同比上涨1.5%，城镇调查失业率平均5.2%。

需求端呈现分化。上半年社零同比增长1.3%，其中服务零售额增长5.3%，6月单月增速回升至1.0%。固定资产投资同比下降5.7%，但高技术制造业投资持续高增，航空、航天器及设备制造业投资增长23.3%。出口表现超预期，货物进出口总额同比增长16.9%，高技术产品出口增长39%，集成电路出口增长96.1%。

新质生产力加速壮大，上半年高技术制造业增加值同比增长13.3%，装备制造业增长9.3%，集成电路产量增长23.1%，新动能对经济增长贡献率超四成。

A股方面，上半年极致分化。上证指数、深证成指、沪深300分别上涨3.16%、19.82%、7.55%，科创50大涨64.25%领跑。行业冰火两重天，电子（+86.29%）、通信（+73.59%）、建筑材料（+46.26%）涨幅居前；商贸零售（-29.42%）、农林牧渔（-25.26%）、美容护理（-24.86%）跌幅居前。

展望下半年，中央政治局会议明确实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，新一轮上涨行情有望延续，市场结构性机会或将继续聚焦科技创新、高端制造、数字经济，流动性保持合理充裕，估值修复空间进一步打开。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,864,846.28	2,728,650.79
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	160,319,994.23	337,821,816.38
其中：股票投资		160,319,994.23	337,821,816.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		164,184,840.51	340,550,467.17
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		369.75	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,701.04	42,599.02
应付托管费		6,900.33	14,199.66
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	702,275.42	157,572.00
负债合计		730,246.54	214,370.68
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	109,804,337.00	259,804,337.00
未分配利润	6.4.7.8	53,650,256.97	80,531,759.49
净资产合计		163,454,593.97	340,336,096.49
负债和净资产总计		164,184,840.51	340,550,467.17

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额净值人民币1.4886元，基金份额总额109,804,337.00份。

6.2 利润表

会计主体：东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		30,080,502.25	40,139,413.99
1.利息收入		10,105.14	81,751.73

其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,105.14	81,751.73
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		55,047,512.79	21,401,340.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	53,686,743.76	15,210,583.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,360,769.03	6,190,756.87
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-25,121,915.84	17,227,655.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	144,800.16	1,428,666.79
减：二、营业总支出		292,377.51	573,072.86
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	161,263.60	370,297.27
2.托管费	6.4.10.2.2	53,754.51	123,432.43
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	77,359.40	79,343.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,788,124.74	39,566,341.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,788,124.74	39,566,341.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		29,788,124.74	39,566,341.13

6.3 净资产变动表

会计主体：东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	259,804,337.00	80,531,759.49	340,336,096.49
二、本期期初净资产	259,804,337.00	80,531,759.49	340,336,096.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-150,000,000.00	-26,881,502.52	-176,881,502.52
（一）、综合收益总额	-	29,788,124.74	29,788,124.74
（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	-150,000,000.00	-56,669,627.26	-206,669,627.26

列)			
其中：1.基金申购款	69,000,000.00	24,513,077.33	93,513,077.33
2.基金赎回款	-219,000,000.00	-81,182,704.59	-300,182,704.59
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	109,804,337.00	53,650,256.97	163,454,593.97
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	721,804,337.00	-676,399.01	721,127,937.99
二、本期期初净资产	721,804,337.00	-676,399.01	721,127,937.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	141,000,000.00	52,136,556.45	193,136,556.45
（一）、综合收益总额	-	39,566,341.13	39,566,341.13
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	141,000,000.00	12,570,215.32	153,570,215.32
其中：1.基金申购款	843,000,000.00	28,686,611.61	871,686,611.61
2.基金赎回款	-702,000,000.00	-16,116,396.29	-718,116,396.29
（三）、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	862,804,337.00	51,460,157.44	914,264,494.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

顾勇	侯福岩	陆文澄
_____	_____	_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金（原西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金，已于2026年4月3日完成更名，以下简称“本基金”）系由基金管理人东财基金管理有限公司（原西藏东财基金管理有限公司，已于2025年9月15日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2024]1753号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为721,804,337.00份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（24）第00252号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2024年12月30日正式生效。本基金的基金管理人为东财基金管理有限公司，基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可少量投资于其他股票（非标的指数成份股或其备选成份股，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、

股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：中证A500指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》

及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）对公募证券投资基金（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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；2027年12月31日前，公募证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

（2）对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

（3）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，暂不征收企业所得税；

（4）对证券投资基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

（5）对于证券投资基金从事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；

（6）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	533,418.92
等于：本金	533,257.19
加：应计利息	161.73
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	3,331,427.36
等于：本金	3,331,214.42
加：应计利息	212.94
减：坏账准备	-
合计	3,864,846.28

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	132,985,573.30	-	160,319,994.23	27,334,420.93

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		132,985,573.30	-	160,319,994.23	27,334,420.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用-审计费	17,852.03
预提费用-信息披露费	59,507.37
可退替代款	5,145.00
应退替代款	614,570.72
其他应付	5,200.30
合计	702,275.42

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	259,804,337.00	259,804,337.00
本期申购	69,000,000.00	69,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-219,000,000.00	-219,000,000.00
本期末	109,804,337.00	109,804,337.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,767,994.77	39,763,764.72	80,531,759.49
本期期初	40,767,994.77	39,763,764.72	80,531,759.49
本期利润	54,910,040.58	-25,121,915.84	29,788,124.74
本期基金份额交易产生的变动数	-42,225,125.57	-14,444,501.69	-56,669,627.26
其中：基金申购款	23,192,721.45	1,320,355.88	24,513,077.33
基金赎回款	-65,417,847.02	-15,764,857.57	-81,182,704.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,452,909.78	197,347.19	53,650,256.97

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	5,525.04
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,580.10
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	10,105.14

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	23,847,237.52
股票投资收益——赎回差价收入	29,839,506.24
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	53,686,743.76

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	186,062,248.20
减：卖出股票成本总额	162,053,201.16
减：交易费用	161,809.52
买卖股票差价收入	23,847,237.52

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
赎回基金份额对价总额	300,182,704.59
减：现金支付赎回款总额	156,345,837.59
减：赎回股票成本总额	113,997,360.76
减：交易费用	-
赎回差价收入	29,839,506.24

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资基金收益

本基金本报告期无资产支持证券投资基金收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,360,769.03
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,360,769.03

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-25,121,915.84
——股票投资	-25,121,915.84
——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	-25,121,915.84

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	144,800.16
合计	144,800.16

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	17,852.03

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	77,359.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东财基金管理有限公司	基金管理人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金托管人、基金销售机构
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商
东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成	成交金额	占当期股票成

		交总额 的比例		交总额 的比例
东财证券	265,690,793.10	100.00%	1,796,579,815.20	100.00%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
东财证券	51,739.74	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
东财证券	348,124.53	100.00%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型

基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	161,263.60	370,297.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,169.36	8,997.78
应支付基金管理人的净管理费	156,094.24	361,299.49

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	53,754.51	123,432.43

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025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	1,910,390.00	1.74%	164,468,983.00	63.30%
东财中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	35,936,500.00	32.73%	29,174,700.00	11.23%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国信证券-托管户	533,418.92	5,525.04	1,000,255.00	4,665.30
东财证券-证券资金户	3,331,427.36	4,580.10	33,172,762.35	77,086.43

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

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金因指数成份股原因被动持有基金管理人的重大利害关系人东方财富信息股份有限公司发行的证券（300059）61,100股，市值为人民币1,245,218.00元，占本基金净资产的比例为0.76%。（于上年度末：持有148,800股，市值为人民币3,449,184.00元，占本基金净资产的比例为1.01%。）

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	新股限售	81.88	1,584.33	49	4,012.12	77,632.17	-

001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	新股限售	10.11	10.11	5,495	55,554.45	55,554.45	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股限售	92.18	463.15	88	8,111.84	40,757.20	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	新股限售	69.66	160.06	233	16,230.78	37,293.98	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	新股限售	44.56	468.67	71	3,163.76	33,275.57	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股限售	26.28	172.09	175	4,599.00	30,115.75	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	新股限售	10.12	27.73	960	9,715.20	26,620.80	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	2,354	23,798.94	23,798.94	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股限售	7.82	20.74	958	7,491.56	19,868.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	新股限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股限售	6.41	24.13	616	3,948.56	14,864.08	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月	新股限售	13.30	51.56	221	2,939.30	11,394.76	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股限售	17.70	84.32	130	2,301.00	10,961.60	-

301669	高特电子	2026-06-02	6个月	新股限售	7.08	28.40	362	2,562.96	10,280.80	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股限售	13.86	73.46	127	1,760.22	9,329.42	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	新股限售	58.00	112.16	70	4,060.00	7,851.20	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	新股限售	17.52	35.92	206	3,609.12	7,399.52	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	新股限售	78.38	121.77	56	4,389.28	6,819.12	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	新股限售	55.95	57.10	104	5,818.80	5,938.40	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股限售	11.18	17.59	330	3,689.40	5,804.70	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股限售	27.19	31.31	183	4,975.77	5,729.73	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	新股限售	30.38	38.99	129	3,919.02	5,029.71	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股限售	53.26	58.74	78	4,154.28	4,581.72	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股限售	15.76	46.71	87	1,371.12	4,063.77	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股限售	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
6032	林平	2026	6个月	新股	37.88	34.87	46	1,74	1,60	-

84	发展	-02-03		限售				2.48	4.02	
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股限售	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股限售	18.38	16.78	72	1,323.36	1,208.16	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股限售	33.49	33.93	35	1,172.15	1,187.55	-

6.4.12.2 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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	1,048	288,287.78	871,936.00	-

注：本基金截至2026年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数基金，采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。若因标的指数编制方法调整，或预期成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,864,846.28	-	-	-	3,864,846.28
交易性金融资产	-	-	-	160,319,994.23	160,319,994.23
资产总计	3,864,846.28	-	-	160,319,994.23	164,184,840.51
负债					
应付清算款	-	-	-	369.75	369.75
应付管理人报酬	-	-	-	20,701.04	20,701.04
应付托管费	-	-	-	6,900.33	6,900.33
其他负债	-	-	-	702,275.42	702,275.42
负债总计	-	-	-	730,246.54	730,246.54
利率敏感度缺口	3,864,846.28	-	-	159,589,747.69	163,454,593.97

上年度 末 2025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	2,728,650.79	-	-	-	2,728,650.79
交易性金融资产	-	-	-	337,821,816.38	337,821,816.38
资产总计	2,728,650.79	-	-	337,821,816.38	340,550,467.17
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	42,599.02	42,599.02
应付托管费	-	-	-	14,199.66	14,199.66
其他负债	-	-	-	157,572.00	157,572.00
负债总计	-	-	-	214,370.68	214,370.68
利率敏感度缺口	2,728,650.79	-	-	337,607,445.70	340,336,096.49

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资，按照标的指数的成份 股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调 整，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金 所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地 对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025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	160,319,994.23	98.08	337,821,816.38	99.26
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	160,319,994.23	98.08	337,821,816.38	99.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	7,983,940.83	16,182,057.06
	业绩比较基准下降5%	-7,983,940.83	-16,182,057.06

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	158,969,483.39	335,516,153.94
第二层次	951,289.39	2,008,261.44
第三层次	399,221.45	297,401.00
合计	160,319,994.23	337,821,816.38

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根

据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2025年12月31日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	160,319,994.23	97.65
	其中：股票	160,319,994.23	97.65
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	3,864,846.28	2.35
8	其他各项资产	-	-

9	合计	164,184,840.51	100.00
---	----	----------------	--------

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	504,092.00	0.31
B	采矿业	6,586,466.00	4.03
C	制造业	112,936,220.27	69.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,485,133.00	2.13
E	建筑业	1,948,300.00	1.19
F	批发和零售业	1,212,175.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	3,563,815.00	2.18
H	住宿和餐饮业	74,522.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,941,906.92	5.47
J	金融业	15,506,243.00	9.49
K	房地产业	894,650.00	0.55
L	租赁和商务服务业	1,155,854.20	0.71
M	科学研究和技术服务业	1,923,626.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	273,086.80	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	53,640.00	0.03
Q	卫生和社会工作	312,623.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	122,895.00	0.08
S	综合	289,632.00	0.18
	合计	159,784,880.19	97.75

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	19,868.92	0.01
C	制造业	432,748.27	0.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,353.39	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	533,554.04	0.33

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	5,300	6,731,000.00	4.12
2	300750	宁德时代	12,700	4,991,227.00	3.05
3	300502	新易盛	6,680	4,054,760.00	2.48
4	600519	贵州茅台	3,000	3,556,470.00	2.18
5	603986	兆易创新	3,200	2,608,000.00	1.60
6	601318	中国平安	51,500	2,458,610.00	1.50
7	688256	寒武纪	1,506	2,402,898.30	1.47
8	600036	招商银行	59,700	2,119,350.00	1.30
9	601899	紫金矿业	79,600	2,001,144.00	1.22
10	002371	北方华创	2,045	1,808,925.20	1.11
11	000333	美的集团	23,400	1,767,402.00	1.08
12	002475	立讯精密	24,600	1,731,840.00	1.06
13	688008	澜起科技	5,419	1,679,348.10	1.03
14	688012	中微公司	3,546	1,661,301.00	1.02
15	688041	海光信息	4,449	1,647,464.70	1.01
16	002384	东山精密	6,200	1,626,570.00	1.00
17	600900	长江电力	59,100	1,564,377.00	0.96
18	688981	中芯国际	9,625	1,528,642.50	0.94
19	000725	京东方 A	175,500	1,523,340.00	0.93
20	603259	药明康德	12,000	1,494,120.00	0.91
21	600030	中信证券	47,100	1,353,183.00	0.83
22	601166	兴业银行	81,700	1,352,952.00	0.83
23	300059	东方财富	61,100	1,245,218.00	0.76
24	600183	生益科技	7,000	1,213,800.00	0.74
25	600276	恒瑞医药	21,600	1,124,064.00	0.69
26	300274	阳光电源	6,980	1,109,959.60	0.68

27	601398	工商银行	156,200	1,104,334.00	0.68
28	300408	三环集团	6,500	1,084,850.00	0.66
29	002594	比亚迪	13,100	1,044,070.00	0.64
30	600487	亨通光电	9,500	1,038,730.00	0.64
31	300476	胜宏科技	2,900	1,004,647.00	0.61
32	601211	国泰海通	54,600	993,720.00	0.61
33	002463	沪电股份	6,500	993,200.00	0.61
34	300394	天孚通信	3,192	966,154.56	0.59
35	688498	源杰科技	493	929,798.00	0.57
36	688525	佰维存储	1,867	923,660.91	0.57
37	301308	江波龙	1,300	914,940.00	0.56
38	000988	华工科技	4,900	904,589.00	0.55
39	688072	拓荆科技	1,048	871,936.00	0.53
40	600176	中国巨石	11,600	845,408.00	0.52
41	601288	农业银行	138,700	841,909.00	0.52
42	601328	交通银行	128,800	828,184.00	0.51
43	000651	格力电器	21,600	810,000.00	0.50
44	600522	中天科技	13,100	794,908.00	0.49
45	603019	中科曙光	7,100	761,333.00	0.47
46	688521	芯原股份	1,999	741,908.86	0.45
47	603993	洛阳钼业	42,100	738,855.00	0.45
48	600150	中国船舶	21,789	736,250.31	0.45
49	600887	伊利股份	30,500	730,780.00	0.45
50	300604	长川科技	2,100	716,982.00	0.44
51	600584	长电科技	6,900	714,495.00	0.44
52	000338	潍柴动力	26,000	708,500.00	0.43
53	000858	五粮液	9,300	688,200.00	0.42
54	688347	华虹宏力	2,018	678,653.40	0.42
55	601816	京沪高铁	141,800	642,354.00	0.39
56	600309	万华化学	9,000	615,690.00	0.38
57	002916	深南电路	1,340	613,586.00	0.38

58	688120	华海清科	1,882	606,342.76	0.37
59	002415	海康威视	17,700	605,340.00	0.37
60	300124	汇川技术	9,100	603,603.00	0.37
61	002008	大族激光	4,000	600,440.00	0.37
62	600111	北方稀土	12,300	591,015.00	0.36
63	002281	光迅科技	2,300	590,962.00	0.36
64	000100	TCL科技	100,400	584,328.00	0.36
65	000063	中兴通讯	15,600	564,564.00	0.35
66	300136	信维通信	4,700	560,475.00	0.34
67	600000	浦发银行	64,300	553,623.00	0.34
68	600089	特变电工	24,400	549,000.00	0.34
69	300857	协创数据	1,600	543,840.00	0.33
70	601857	中国石油	62,600	543,368.00	0.33
71	002028	思源电气	3,000	519,000.00	0.32
72	601088	中国神华	13,200	515,328.00	0.32
73	300433	蓝思科技	9,600	515,136.00	0.32
74	600031	三一重工	28,600	494,208.00	0.30
75	300014	亿纬锂能	7,300	474,719.00	0.29
76	002050	三花智控	10,800	473,364.00	0.29
77	601601	中国太保	16,500	470,580.00	0.29
78	000001	平安银行	46,800	470,340.00	0.29
79	000792	盐湖股份	15,400	464,926.00	0.28
80	002714	牧原股份	13,200	461,868.00	0.28
81	600549	厦门钨业	5,400	460,080.00	0.28
82	300475	香农芯创	1,500	450,000.00	0.28
83	300223	北京君正	1,800	448,020.00	0.27
84	600406	国电南瑞	19,400	443,290.00	0.27
85	002353	杰瑞股份	2,900	442,250.00	0.27
86	002156	通富微电	5,800	440,046.00	0.27
87	601668	中国建筑	99,700	432,698.00	0.26
88	000657	中钨高新	4,400	421,168.00	0.26

89	002436	兴森科技	8,200	417,790.00	0.26
90	002602	世纪华通	28,500	401,850.00	0.25
91	601919	中远海控	30,300	401,778.00	0.25
92	601988	中国银行	69,100	395,252.00	0.24
93	300760	迈瑞医疗	2,900	393,907.00	0.24
94	600660	福耀玻璃	7,800	393,432.00	0.24
95	300054	鼎龙股份	3,700	392,089.00	0.24
96	603501	豪威集团	4,100	388,885.00	0.24
97	601728	中国电信	74,900	388,731.00	0.24
98	601012	隆基绿能	29,300	384,416.00	0.24
99	601225	陕西煤业	18,700	380,545.00	0.23
100	600941	中国移动	4,400	378,972.00	0.23
101	002230	科大讯飞	9,200	375,728.00	0.23
102	300757	罗博特科	600	371,400.00	0.23
103	600690	海尔智家	18,100	369,421.00	0.23
104	688777	中控技术	3,133	368,127.50	0.23
105	002352	顺丰控股	11,600	362,616.00	0.22
106	601985	中国核电	39,700	358,491.00	0.22
107	002709	天赐材料	6,900	354,867.00	0.22
108	002460	赣锋锂业	5,400	353,160.00	0.22
109	603799	华友钴业	7,300	352,298.00	0.22
110	300033	同花顺	1,460	351,860.00	0.22
111	000977	浪潮信息	5,000	350,000.00	0.21
112	002938	鹏鼎控股	3,300	347,754.00	0.21
113	600160	巨化股份	6,500	344,565.00	0.21
114	300442	润泽科技	4,000	332,280.00	0.20
115	000425	徐工机械	39,600	320,364.00	0.20
116	000938	紫光股份	11,100	320,346.00	0.20
117	002202	金风科技	13,300	317,870.00	0.19
118	002851	麦格米特	1,900	317,642.00	0.19
119	300567	精测电子	1,000	317,600.00	0.19

120	688126	沪硅产业	7,959	317,484.51	0.19
121	600938	中国海油	11,600	314,940.00	0.19
122	601600	中国铝业	38,200	314,004.00	0.19
123	600028	中国石化	70,300	313,538.00	0.19
124	300346	南大光电	3,320	307,598.00	0.19
125	002466	天齐锂业	5,000	306,600.00	0.19
126	600460	士兰微	5,600	306,096.00	0.19
127	601766	中国中车	58,800	305,760.00	0.19
128	002600	领益智造	17,600	305,184.00	0.19
129	600050	中国联通	75,500	302,000.00	0.18
130	300661	圣邦股份	2,080	298,438.40	0.18
131	002837	英维克	3,690	293,576.40	0.18
132	002049	紫光国微	3,300	292,875.00	0.18
133	002080	中材科技	3,200	288,000.00	0.18
134	601628	中国人寿	8,100	286,335.00	0.18
135	002185	华天科技	12,800	285,568.00	0.17
136	002138	顺络电子	3,900	285,090.00	0.17
137	002179	中航光电	6,100	281,820.00	0.17
138	601100	恒立液压	2,600	279,656.00	0.17
139	000568	泸州老窖	3,600	279,072.00	0.17
140	688002	睿创微纳	1,800	278,442.00	0.17
141	002407	多氟多	5,500	276,265.00	0.17
142	601872	招商轮船	15,600	274,092.00	0.17
143	600879	航天电子	12,700	270,383.00	0.17
144	002241	歌尔股份	12,000	270,360.00	0.17
145	603288	海天味业	8,100	268,596.00	0.16
146	300395	菲利华	2,000	267,460.00	0.16
147	601006	大秦铁路	57,500	265,075.00	0.16
148	000408	藏格矿业	3,800	263,416.00	0.16
149	601658	邮储银行	53,200	262,276.00	0.16
150	300390	天华新能	2,800	261,828.00	0.16

151	688469	芯联集成	24,225	257,027.25	0.16
152	688396	华润微	2,630	256,556.50	0.16
153	600905	三峡能源	69,000	255,990.00	0.16
154	605117	德业股份	2,400	254,832.00	0.16
155	002625	光启技术	8,400	254,688.00	0.16
156	600489	中金黄金	14,000	252,700.00	0.15
157	601888	中国中免	4,700	252,437.00	0.15
158	688271	联影医疗	2,448	247,811.04	0.15
159	000630	铜陵有色	38,800	246,768.00	0.15
160	600893	航发动力	6,400	245,376.00	0.15
161	600673	东阳光	7,300	245,134.00	0.15
162	601127	赛力斯	4,000	245,000.00	0.15
163	600010	包钢股份	109,200	243,516.00	0.15
164	300058	蓝色光标	17,320	238,323.20	0.15
165	601689	拓普集团	4,200	236,964.00	0.14
166	002027	分众传媒	48,800	236,192.00	0.14
167	300037	新宙邦	2,500	232,125.00	0.14
168	002273	水晶光电	6,500	230,620.00	0.14
169	600118	中国卫星	2,800	229,740.00	0.14
170	688017	绿的谐波	549	229,405.14	0.14
171	600019	宝钢股份	42,000	228,060.00	0.14
172	300751	迈为股份	800	225,968.00	0.14
173	688111	金山办公	1,058	225,406.90	0.14
174	000426	兴业银锡	6,800	224,128.00	0.14
175	600760	中航沈飞	5,400	221,940.00	0.14
176	000807	云铝股份	10,000	221,400.00	0.14
177	601168	西部矿业	8,100	219,834.00	0.13
178	600104	上汽集团	22,200	216,672.00	0.13
179	600362	江西铜业	5,000	216,500.00	0.13
180	300450	先导智能	5,300	215,816.00	0.13
181	688099	晶晨股份	2,095	215,575.50	0.13

182	600989	宝丰能源	10,600	215,498.00	0.13
183	600988	赤峰黄金	8,100	213,192.00	0.13
184	600875	东方电气	7,400	212,898.00	0.13
185	601727	上海电气	30,400	212,800.00	0.13
186	002001	新 和 成	7,400	210,308.00	0.13
187	605589	圣泉集团	3,300	209,781.00	0.13
188	002422	科伦药业	5,400	208,008.00	0.13
189	600667	太极实业	7,100	207,178.00	0.13
190	002738	中矿资源	3,500	206,465.00	0.13
191	601390	中国中铁	49,400	205,998.00	0.13
192	000960	锡业股份	4,800	204,912.00	0.13
193	600885	宏发股份	5,920	204,180.80	0.12
194	002126	银轮股份	4,100	204,180.00	0.12
195	000538	云南白药	4,300	203,691.00	0.12
196	600547	山东黄金	8,800	203,192.00	0.12
197	600392	盛和资源	6,800	202,436.00	0.12
198	600795	国电电力	43,000	200,810.00	0.12
199	000831	中国稀土	3,600	199,764.00	0.12
200	600585	海螺水泥	11,600	196,620.00	0.12
201	600418	江淮汽车	7,600	196,308.00	0.12
202	601669	中国电建	41,500	195,050.00	0.12
203	600141	兴发集团	4,100	192,577.00	0.12
204	002648	卫星化学	8,100	190,269.00	0.12
205	002129	TCL中环	15,600	187,512.00	0.11
206	002812	恩捷股份	2,800	187,348.00	0.11
207	300316	晶盛机电	3,100	187,240.00	0.11
208	300015	爱尔眼科	22,500	185,850.00	0.11
209	600096	云天化	6,100	185,440.00	0.11
210	601179	中国西电	12,400	185,008.00	0.11
211	301358	湖南裕能	2,400	182,088.00	0.11
212	600346	恒力石化	10,200	180,642.00	0.11

213	601868	中国能建	67,500	180,225.00	0.11
214	002195	岩山科技	27,300	178,542.00	0.11
215	300418	昆仑万维	4,400	177,584.00	0.11
216	000066	中国长城	9,300	177,165.00	0.11
217	600482	中国动力	5,400	177,120.00	0.11
218	600497	驰宏锌锗	14,600	176,806.00	0.11
219	002558	巨人网络	6,400	176,384.00	0.11
220	600580	卧龙电驱	5,300	175,430.00	0.11
221	300782	卓胜微	1,600	175,328.00	0.11
222	600066	宇通客车	6,400	171,584.00	0.10
223	000625	长安汽车	23,900	171,363.00	0.10
224	600426	华鲁恒升	7,100	169,832.00	0.10
225	600157	永泰能源	105,400	169,694.00	0.10
226	002532	天山铝业	15,700	168,461.00	0.10
227	688036	传音控股	2,849	167,948.55	0.10
228	600221	海航控股	124,200	167,670.00	0.10
229	600895	张江高科	4,500	167,625.00	0.10
230	688047	龙芯中科	1,083	167,507.61	0.10
231	000157	中联重科	23,900	166,583.00	0.10
232	688235	百济神州	651	165,751.11	0.10
233	605499	东鹏饮料	1,330	164,161.90	0.10
234	600436	片仔癀	1,500	163,920.00	0.10
235	600711	盛屯矿业	14,900	163,453.00	0.10
236	002340	格林美	24,600	162,606.00	0.10
237	002821	凯莱英	1,000	162,000.00	0.10
238	000933	神火股份	7,600	161,120.00	0.10
239	600011	华能国际	21,200	160,908.00	0.10
240	600048	保利发展	34,600	160,198.00	0.10
241	600143	金发科技	10,300	159,135.00	0.10
242	600438	通威股份	13,000	157,430.00	0.10
243	300017	网宿科技	12,100	157,421.00	0.10

244	600115	中国东航	41,100	156,591.00	0.10
245	002493	荣盛石化	14,500	155,875.00	0.10
246	300803	指南针	1,700	155,839.00	0.10
247	002131	利欧股份	32,700	155,325.00	0.10
248	002236	大华股份	9,400	155,006.00	0.09
249	600570	恒生电子	7,300	154,687.00	0.09
250	600886	国投电力	11,600	154,396.00	0.09
251	002456	欧菲光	16,200	153,252.00	0.09
252	600352	浙江龙盛	12,500	151,375.00	0.09
253	603659	璞泰来	5,200	150,436.00	0.09
254	300339	润和软件	3,900	150,189.00	0.09
255	601233	桐昆股份	6,900	149,385.00	0.09
256	003816	中国广核	37,900	148,189.00	0.09
257	601360	三六零	16,900	146,861.00	0.09
258	601058	赛轮轮胎	12,700	146,431.00	0.09
259	002074	国轩高科	5,300	145,803.00	0.09
260	000301	东方盛虹	12,700	145,415.00	0.09
261	600026	中远海能	8,100	145,314.00	0.09
262	300759	康龙化成	5,000	144,650.00	0.09
263	688213	思特威	1,328	142,188.96	0.09
264	002555	三七互娱	7,500	141,525.00	0.09
265	688122	西部超导	2,251	141,385.31	0.09
266	600009	上海机场	6,000	138,600.00	0.08
267	688578	艾力斯	1,266	138,247.20	0.08
268	000975	山金国际	8,100	137,700.00	0.08
269	000768	中航西飞	6,700	137,216.00	0.08
270	600196	复星医药	6,100	137,067.00	0.08
271	002472	双环传动	3,300	136,983.00	0.08
272	300001	特锐德	3,600	136,188.00	0.08
273	601111	中国国航	22,500	136,125.00	0.08
274	002517	恺英网络	8,300	134,875.00	0.08

275	300207	欣旺达	7,100	134,829.00	0.08
276	600029	南方航空	26,000	134,680.00	0.08
277	300458	全志科技	3,400	134,164.00	0.08
278	600415	小商品城	13,200	134,112.00	0.08
279	002601	龙佰集团	8,100	133,488.00	0.08
280	600674	川投能源	9,400	133,198.00	0.08
281	600219	南山铝业	33,300	132,867.00	0.08
282	300438	鹏辉能源	1,600	132,560.00	0.08
283	601186	中国铁建	22,200	132,090.00	0.08
284	002128	电投能源	5,700	131,784.00	0.08
285	600233	圆通速递	8,300	130,725.00	0.08
286	601877	正泰电器	5,200	130,364.00	0.08
287	601117	中国化学	17,700	130,095.00	0.08
288	300115	长盈精密	4,600	128,524.00	0.08
289	603129	春风动力	500	127,900.00	0.08
290	002595	豪迈科技	2,735	127,451.00	0.08
291	301236	软通动力	3,000	127,350.00	0.08
292	600372	中航机载	11,700	126,945.00	0.08
293	002155	湖南黄金	5,300	126,511.00	0.08
294	300454	深信服	1,300	125,060.00	0.08
295	600839	四川长虹	17,800	124,244.00	0.08
296	002465	海格通信	9,600	122,592.00	0.08
297	002920	德赛西威	1,500	122,250.00	0.07
298	300568	星源材质	6,500	121,680.00	0.07
299	000963	华东医药	4,300	120,916.00	0.07
300	300347	泰格医药	2,500	120,000.00	0.07
301	600741	华域汽车	7,600	117,952.00	0.07
302	603650	彤程新材	1,200	117,576.00	0.07
303	000547	航天发展	6,100	116,815.00	0.07
304	300024	机器人	6,000	115,980.00	0.07
305	002130	沃尔核材	6,100	115,656.00	0.07

306	688676	金盘科技	1,366	115,618.24	0.07
307	300866	安克创新	1,100	114,950.00	0.07
308	688331	荣昌生物	881	114,759.06	0.07
309	688506	百利天恒	390	114,671.70	0.07
310	688266	泽璟制药	971	113,276.86	0.07
311	688608	恒玄科技	674	112,686.06	0.07
312	300012	华测检测	8,100	112,266.00	0.07
313	002497	雅化集团	5,500	112,035.00	0.07
314	001979	招商蛇口	17,400	111,882.00	0.07
315	000878	云南铜业	7,000	111,160.00	0.07
316	300083	创世纪	8,100	110,322.00	0.07
317	002414	高德红外	8,300	110,058.00	0.07
318	000034	神州数码	3,940	109,335.00	0.07
319	002271	东方雨虹	9,200	109,204.00	0.07
320	002444	巨星科技	3,500	108,850.00	0.07
321	300763	锦浪科技	1,200	108,420.00	0.07
322	688169	石头科技	1,126	106,936.22	0.07
323	002025	航天电器	1,400	106,708.00	0.07
324	603979	金诚信	1,800	106,254.00	0.07
325	002432	九安医疗	1,500	106,020.00	0.06
326	300496	中科创达	1,700	105,043.00	0.06
327	601021	春秋航空	2,300	104,834.00	0.06
328	601319	中国人保	15,500	104,780.00	0.06
329	300474	景嘉微	1,700	102,816.00	0.06
330	002756	永兴材料	1,800	101,952.00	0.06
330	000733	振华科技	1,800	101,952.00	0.06
331	601615	明阳智能	8,800	101,816.00	0.06
332	300748	金力永磁	3,300	101,805.00	0.06
333	600699	均胜电子	4,700	101,567.00	0.06
334	002078	太阳纸业	8,100	101,169.00	0.06
335	300073	当升科技	2,100	100,884.00	0.06

336	300432	富临精工	5,000	100,450.00	0.06
337	300142	沃森生物	7,700	100,023.00	0.06
338	000661	长春高新	1,500	99,900.00	0.06
339	601677	明泰铝业	6,000	99,600.00	0.06
340	300724	捷佳伟创	1,400	98,840.00	0.06
341	600039	四川路桥	12,600	98,532.00	0.06
342	603606	东方电缆	2,360	97,963.60	0.06
343	688188	柏楚电子	917	97,843.90	0.06
344	601800	中国交建	17,100	97,641.00	0.06
345	000002	万 科 A	32,900	97,384.00	0.06
346	002252	上海莱士	22,300	96,782.00	0.06
347	603087	甘李药业	1,700	96,492.00	0.06
348	300919	中伟新材	2,200	96,250.00	0.06
349	600226	亨通股份	10,000	95,900.00	0.06
350	688599	天合光能	6,757	95,408.84	0.06
351	000423	东阿阿胶	2,100	95,256.00	0.06
352	688223	晶科能源	19,808	94,088.00	0.06
353	688390	固德威	859	93,210.09	0.06
354	600588	用友网络	9,900	90,882.00	0.06
355	601633	长城汽车	6,000	90,540.00	0.06
356	000786	北新建材	5,000	90,450.00	0.06
357	002064	华峰化学	9,500	90,155.00	0.06
358	688180	君实生物	2,656	89,825.92	0.05
359	001965	招商公路	9,800	89,768.00	0.05
360	002831	裕同科技	2,500	88,900.00	0.05
361	302132	中航成飞	1,500	87,480.00	0.05
362	300972	万辰集团	500	86,705.00	0.05
363	300677	英科医疗	2,200	86,174.00	0.05
364	002294	信立泰	2,700	86,103.00	0.05
365	603806	福斯特	5,100	85,629.00	0.05
366	300558	贝达药业	1,300	84,591.00	0.05

367	600177	雅戈尔	11,200	84,336.00	0.05
368	000519	中兵红箭	4,000	84,280.00	0.05
369	688065	凯赛生物	1,759	84,168.15	0.05
370	601618	中国中冶	34,400	83,936.00	0.05
371	600516	方大炭素	13,600	83,912.00	0.05
372	002176	江特电机	8,300	83,083.00	0.05
373	603260	合盛硅业	1,700	82,042.00	0.05
374	601607	上海医药	5,300	81,620.00	0.05
375	000623	吉林敖东	4,600	81,558.00	0.05
376	000617	中油资本	12,200	80,398.00	0.05
377	300699	光威复材	2,800	80,220.00	0.05
378	002085	万丰奥威	7,200	79,848.00	0.05
379	002318	久立特材	3,300	78,870.00	0.05
380	300251	光线传媒	7,100	78,739.00	0.05
381	002459	晶澳科技	9,600	77,760.00	0.05
382	688617	惠泰医疗	426	77,344.56	0.05
383	002065	东华软件	10,800	77,112.00	0.05
384	002266	浙富控股	15,100	76,406.00	0.05
385	600085	同仁堂	3,300	76,263.00	0.05
386	002044	美年健康	15,100	75,953.00	0.05
387	600499	科达制造	5,500	75,900.00	0.05
388	688472	阿特斯	7,013	75,880.66	0.05
389	688005	容百科技	2,477	75,796.20	0.05
390	300409	道氏技术	3,800	75,734.00	0.05
391	300832	新产业	1,800	75,600.00	0.05
392	600515	海南机场	27,500	75,350.00	0.05
393	300342	天银机电	1,600	75,200.00	0.05
394	603596	伯特利	3,004	74,619.36	0.05
395	002223	鱼跃医疗	2,900	74,414.00	0.05
396	002405	四维图新	11,500	74,405.00	0.05
397	605090	九丰能源	2,000	74,340.00	0.05

398	000400	许继电气	3,400	73,780.00	0.05
399	300003	乐普医疗	6,200	73,470.00	0.04
400	600521	华海药业	5,100	73,440.00	0.04
401	301550	斯菱智驱	800	73,144.00	0.04
402	000415	渤海租赁	17,900	72,853.00	0.04
403	000683	博源化工	12,600	72,576.00	0.04
404	000032	深桑达 A	2,900	72,355.00	0.04
405	601216	君正集团	16,200	72,252.00	0.04
406	000039	中集集团	8,900	72,179.00	0.04
407	600862	中航高科	4,000	72,120.00	0.04
408	603605	珀莱雅	1,200	71,904.00	0.04
409	000999	华润三九	3,180	71,518.20	0.04
410	600803	新奥股份	4,500	71,100.00	0.04
411	600704	物产中大	15,000	70,800.00	0.04
412	603766	隆鑫通用	5,900	70,387.00	0.04
413	300896	爱美客	800	69,760.00	0.04
414	688116	天奈科技	1,814	69,294.80	0.04
415	600018	上港集团	14,600	68,912.00	0.04
416	600312	平高电气	3,900	68,874.00	0.04
417	600765	中航重机	5,300	68,476.00	0.04
418	000967	盈峰环境	6,500	68,445.00	0.04
419	600332	白云山	3,400	68,136.00	0.04
420	000887	中鼎股份	3,800	67,982.00	0.04
421	600166	福田汽车	23,000	66,930.00	0.04
422	300122	智飞生物	5,700	66,633.00	0.04
423	600153	建发股份	8,400	66,612.00	0.04
424	000830	鲁西化工	5,500	66,000.00	0.04
425	002410	广联达	8,000	65,280.00	0.04
426	002007	华兰生物	5,300	64,607.00	0.04
427	601799	星宇股份	700	63,434.00	0.04
428	600323	瀚蓝环境	2,300	63,158.00	0.04

429	603568	伟明环保	3,960	60,904.80	0.04
430	600486	扬农化工	1,200	60,840.00	0.04
431	600398	海澜之家	11,600	60,668.00	0.04
432	002603	以岭药业	4,000	60,000.00	0.04
433	601000	唐山港	14,300	59,345.00	0.04
434	688009	中国通号	12,457	59,295.32	0.04
435	601018	宁波港	18,800	59,220.00	0.04
436	688114	华大智造	1,157	59,099.56	0.04
437	600529	山东药玻	3,200	59,040.00	0.04
438	002389	航天彩虹	3,300	58,641.00	0.04
439	000738	航发控制	3,200	58,528.00	0.04
440	600208	衢州发展	20,500	58,015.00	0.04
441	600008	首创环保	21,300	57,936.00	0.04
442	600170	上海建工	25,800	57,276.00	0.04
443	000932	华菱钢铁	16,500	57,255.00	0.04
444	600998	九州通	12,200	57,218.00	0.04
445	688166	博瑞医药	1,608	56,296.08	0.03
446	600316	洪都航空	2,000	55,880.00	0.03
447	603486	科沃斯	1,100	55,825.00	0.03
448	600161	天坛生物	4,800	55,584.00	0.03
449	688303	大全能源	3,186	55,531.98	0.03
450	600820	隧道股份	10,600	55,226.00	0.03
451	300118	东方日升	4,400	54,780.00	0.03
452	603885	吉祥航空	5,300	54,537.00	0.03
453	601238	广汽集团	10,700	54,356.00	0.03
454	002607	中公教育	29,800	53,640.00	0.03
455	300676	华大基因	1,500	52,590.00	0.03
456	603939	益丰药房	2,900	52,142.00	0.03
457	300573	兴齐眼药	1,263	51,479.88	0.03
458	603816	顾家家居	2,300	51,428.00	0.03
459	600763	通策医疗	1,500	50,820.00	0.03

460	601567	三星电气	3,400	50,796.00	0.03
461	300049	福瑞医科	1,300	50,544.00	0.03
462	601880	辽港股份	35,500	48,990.00	0.03
463	603392	万泰生物	1,800	48,546.00	0.03
464	600038	中直股份	1,900	48,051.00	0.03
465	600535	天士力	3,600	47,628.00	0.03
466	600511	国药股份	1,800	46,872.00	0.03
467	688063	派能科技	871	46,398.17	0.03
468	600816	建元信托	19,000	46,360.00	0.03
469	002244	滨江集团	6,000	45,600.00	0.03
470	601155	新城控股	4,400	45,144.00	0.03
471	002120	韵达股份	7,000	44,520.00	0.03
472	000833	粤桂股份	1,900	44,498.00	0.03
473	300100	双林股份	1,600	44,448.00	0.03
474	300144	宋城演艺	7,600	44,156.00	0.03
475	000998	隆平高科	5,600	42,224.00	0.03
476	002544	普天科技	2,300	41,906.00	0.03
477	601866	中远海发	18,900	41,769.00	0.03
478	600064	南京高科	5,800	41,354.00	0.03
479	600635	大众公用	9,300	39,804.00	0.02
480	600754	锦江酒店	2,200	39,578.00	0.02
481	000035	中国天楹	8,100	39,123.00	0.02
482	600655	豫园股份	9,400	38,634.00	0.02
483	300457	赢合科技	1,800	37,944.00	0.02
484	600004	白云机场	5,000	36,300.00	0.02
485	300601	康泰生物	3,200	36,288.00	0.02
486	600663	陆家嘴	5,700	35,796.00	0.02
487	603899	晨光股份	1,700	35,071.00	0.02
488	600258	首旅酒店	3,200	34,944.00	0.02
489	600859	王府井	3,800	34,884.00	0.02
490	002091	江苏国泰	4,700	33,981.00	0.02

491	300070	碧水源	10,500	33,495.00	0.02
492	000069	华侨城 A	19,400	31,816.00	0.02
493	600864	哈投股份	6,000	31,140.00	0.02
494	301078	孩子王	4,300	29,068.00	0.02
495	002292	奥飞娱乐	4,300	28,208.00	0.02
496	603833	欧派家居	900	27,099.00	0.02
497	002891	中宠股份	1,000	26,720.00	0.02
498	600325	华发股份	10,600	24,486.00	0.01
499	002572	索菲亚	2,800	20,440.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001399	惠科股份	2,400	81,600.00	0.05
2	001248	华润新能源	7,849	79,353.39	0.05
3	688808	联讯仪器	49	77,632.17	0.05
4	688785	恒运昌	88	40,757.20	0.02
5	301682	宏明电子	233	37,293.98	0.02
6	688797	臻宝科技	71	33,275.57	0.02
7	688813	泰金新能	175	30,115.75	0.02
8	001257	盛龙股份	958	19,868.92	0.01
9	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
10	688811	有研复材	616	14,864.08	0.01
11	301531	春光集团	221	11,394.76	0.01
12	603459	红板科技	130	10,961.60	0.01
13	301669	高特电子	362	10,280.80	0.01
14	603407	长裕集团	127	9,329.42	0.01
15	301680	固德电材	70	7,851.20	0.00
16	688712	北芯生命	206	7,399.52	0.00

17	301683	慧谷新材	56	6,819.12	0.00
18	688816	易思维	104	5,938.40	0.00
19	601112	振石股份	330	5,804.70	0.00
20	001365	天海电子	183	5,729.73	0.00
21	001393	维通利	129	5,029.71	0.00
22	001237	惠康科技	78	4,581.72	0.00
23	603435	嘉德利	87	4,063.77	0.00
24	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
25	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
26	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
27	001312	福恩股份	72	1,208.16	0.00
28	603293	埃泰克	35	1,187.55	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,150,994.00	1.22
2	601318	中国平安	2,337,222.00	0.69
3	688041	海光信息	2,103,420.61	0.62
4	601899	紫金矿业	1,975,313.00	0.58
5	300308	中际旭创	1,602,568.00	0.47
6	600036	招商银行	1,596,443.00	0.47
7	600900	长江电力	1,107,694.00	0.33
8	688008	澜起科技	1,097,842.13	0.32
9	002371	北方华创	1,050,068.00	0.31
10	601166	兴业银行	1,031,948.00	0.30
11	300750	宁德时代	943,527.00	0.28
12	603986	兆易创新	870,875.00	0.26

13	600030	中信证券	839,969.00	0.25
14	600436	片仔癀	809,153.00	0.24
15	600276	恒瑞医药	805,782.00	0.24
16	688981	中芯国际	782,984.98	0.23
17	601398	工商银行	772,227.00	0.23
18	600309	万华化学	732,978.00	0.22
19	688498	源杰科技	726,847.65	0.21
20	603259	药明康德	712,916.00	0.21

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	10,136,554.50	2.98
2	601318	中国平安	6,919,904.00	2.03
3	601899	紫金矿业	6,152,201.00	1.81
4	600036	招商银行	4,931,212.00	1.45
5	688041	海光信息	3,813,650.54	1.12
6	600900	长江电力	3,384,362.00	0.99
7	601166	兴业银行	3,289,569.00	0.97
8	600030	中信证券	2,657,107.00	0.78
9	600276	恒瑞医药	2,578,337.00	0.76
10	688981	中芯国际	2,442,989.72	0.72
11	601398	工商银行	2,437,898.00	0.72
12	603986	兆易创新	2,403,357.00	0.71
13	603259	药明康德	2,385,702.00	0.70
14	688008	澜起科技	2,376,599.87	0.70
15	601211	国泰海通	2,176,314.00	0.64
16	688256	寒武纪	2,035,981.33	0.60

17	601288	农业银行	2,007,773.00	0.59
18	603993	洛阳钼业	1,925,135.00	0.57
19	601328	交通银行	1,874,192.00	0.55
20	600309	万华化学	1,808,564.00	0.53

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	80,497,607.01
卖出股票收入（成交）总额	186,062,248.20

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

招商银行：2026年7月17日和2025年9月12日，国家金融监督管理总局对招商银行股份有限公司处以行政处罚。

本基金为指数型基金，采取完全复制策略，跟踪的标的指数为中证A500指数，以上股票为指数成份股。以上股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除此以外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	001248	华润新能源	79,353.39	0.05	新股未上市
2	688808	联讯仪器	77,632.17	0.05	新股限售
3	688785	恒运昌	40,757.20	0.02	新股限售
4	301682	宏明电子	37,293.98	0.02	新股限售
5	001399	惠科股份	26,620.80	0.02	新股限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		东财中证A500 交易型开放式 指数证券投资 基金联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
4,277	25,673.21	46,076,647.00	41.96%	63,727,690.00	58.04%	35,936,500.00	32.73%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“东财中证A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

8.3 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2024年12月30日)基金份额总额	721,804,337.00
本报告期期初基金份额总额	259,804,337.00
本报告期基金总申购份额	69,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	219,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	109,804,337.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：（1）自2026年2月13日起，倪永彪新任基金管理人督察长，离任总经理助理；沙福贵不再代任督察长。（2）自2026年2月27日起，顾勇新任基金管理人总经理、财务负责人，离任副总经理；沙福贵离任总经理、财务负责人。（3）根据基金管理人2026年2月28日发布的《东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告》，基金管理人近12个月内进行了董事变更。

基金托管人：本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期无托管人受调查或处罚等情况

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期无托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东财证券	6	265,690,793.10	100.00%	51,739.74	100.00%	-

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况等因素的基础上，选择证券经纪商。
- 3、选择券商的程序：
 - （1）本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；
 - （2）本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增东方财富证券股份有限公司为部分基金流动性服务商的公告	证监会规定网站及报刊	2026-01-19
2	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金2025年第4季度报告	证监会规定网站	2026-01-22
3	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	2026-01-29
4	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-05
5	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-02-07
6	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2026-02-07
7	东财基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-14
8	东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
9	东财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
10	东财基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	证监会规定网站及报刊	2026-03-31
11	西藏东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金2025	证监会规定网站	2026-03-31

	年年度报告		
12	东财基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金全称的公告	证监会规定网站及报刊	2026-04-03
13	东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-04-03
14	东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金托管协议	证监会规定网站	2026-04-03
15	东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同	证监会规定网站	2026-04-03
16	东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2026-04-03
17	东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金2026年第1季度报告	证监会规定网站	2026-04-21
18	东财基金管理有限公司关于旗下证券投资基金投资资产支持证券的公告	证监会规定网站及报刊	2026-05-13
19	东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-06-27
20	东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	证监会规定网站	2026-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	2026-01-01至2026-03-16	164,468,983.00	32,401,040.00	194,959,633.00	1,910,390.00	1.74%
ETF联接基金	1	2026-01-28至2026-02-03, 2026-02-05至2026-06-30	29,174,700.00	46,887,400.00	40,125,600.00	35,936,500.00	32.73%
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- 二、《东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 三、《东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

东财基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日