

东财中证 500 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:中国国际金融股份有限公司

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。

基金托管人中国国际金融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.....	6
§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.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	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.....	13
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.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
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.....	62
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.....	62
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.....	63
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.....	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§8 基金份额持有人信息.....	64

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	65
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	66
10.8 其他重大事件	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东财中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证500ETF基金
场内简称	中证500ETF东财
基金主代码	159337
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年09月02日
基金管理人	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	233,710,611.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024年09月20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500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	中国国际金融股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾勇	刘晴川
	联系电话	021-23526999	010-65051166
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	AC_Product@cicc.com.cn
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	北京市朝阳区建国门外大街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	北京市朝阳区建国门外大街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	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	120,050,796.25
本期利润	114,271,962.44
加权平均基金份额本期利润	0.3862
本期加权平均净值利润率	20.81%
本期基金份额净值增长率	22.87%
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	193,292,070.88
期末可供分配基金份额利润	0.8271
期末基金资产净值	480,304,447.40
期末基金份额净值	2.0551
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	105.51%

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	20.27%	1.64%	18.56%	1.65%	1.71%	-0.01%
过去六个月	22.87%	1.65%	20.97%	1.66%	1.90%	-0.01%
过去一年	56.16%	1.41%	52.68%	1.42%	3.48%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	105.51%	1.58%	98.63%	1.60%	6.88%	-0.02%

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



注：1、本基金基金合同于2024年9月2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	2024-09-02	-	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	本基金基金经理助理	2024-09-02	-	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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证500指数，该指数反映沪深市场中小盘市值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，中证500ETF基金份额净值为2.0551元，报告期内基金份额净值增长率为22.87%，同期业绩比较基准收益率为20.97%。

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§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500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	5,168,466.05	6,008,509.86
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	475,849,686.12	580,303,481.54
其中：股票投资		475,849,686.12	580,303,481.54
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		-	42,774.57
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		481,018,152.17	586,354,765.97
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		3,413.66	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		194,564.39	243,893.23
应付托管费		19,456.44	24,389.30
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	496,270.28	1,175,923.81
负债合计		713,704.77	1,444,206.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	233,710,611.00	349,710,611.00
未分配利润	6.4.7.8	246,593,836.40	235,199,948.63
净资产合计		480,304,447.40	584,910,559.63
负债和净资产总计		481,018,152.17	586,354,765.97

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额净值人民币2.0551元，基金份额总额233,710,611.00份。

6.2 利润表

会计主体：东财中证500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		115,856,838.83	73,706,955.70
1.利息收入		10,072.20	24,319.23
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,072.20	24,319.23
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）		121,377,586.80	26,531,436.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	118,464,764.91	14,254,644.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资			
收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,912,821.89	12,276,792.07
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	-5,778,833.81	46,707,805.55
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	248,013.64	443,394.35
减：二、营业总支出		1,584,876.39	3,448,532.98
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,368,666.57	3,062,899.86
2.托管费	6.4.10.2.2	136,866.66	306,289.96
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	79,343.16	79,343.16

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		114,271,962.44	70,258,422.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		114,271,962.44	70,258,422.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		114,271,962.44	70,258,422.72

6.3 净资产变动表

会计主体：东财中证500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	349,710,611.00	235,199,948.63	584,910,559.63
二、本期期初净资产	349,710,611.00	235,199,948.63	584,910,559.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-116,000,000.00	11,393,887.77	-104,606,112.23
（一）、综合收益总额	-	114,271,962.44	114,271,962.44
（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）	-116,000,000.00	-102,878,074.67	-218,878,074.67
其中：1.基金申购款	78,000,000.00	64,640,454.86	142,640,454.86
2.基金赎回款	-194,000,000.00	-167,518,529.53	-361,518,529.53

（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	233,710,611.00	246,593,836.40	480,304,447.40
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	825,710,611.00	216,104,524.49	1,041,815,135.49
二、本期期初净资产	825,710,611.00	216,104,524.49	1,041,815,135.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	310,000,000.00	142,756,682.65	452,756,682.65
（一）、综合收益总额	-	70,258,422.72	70,258,422.72
（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）	310,000,000.00	72,498,259.93	382,498,259.93
其中：1.基金申购款	464,000,000.00	116,122,854.02	580,122,854.02
2.基金赎回款	-154,000,000.00	-43,624,594.09	-197,624,594.09
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,135,710,611.00	358,861,207.14	1,494,571,818.14

产			
---	--	--	--

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500交易型开放式指数证券投资基金（原西藏东财中证500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500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500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]1015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211,710,611.00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00145号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2024年9月2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，基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

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、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：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%。本基金可以根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的业绩比较基准为：中证500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	1,000,214.99	
等于：本金	1,000,014.91	
加：应计利息	200.08	
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	4,168,251.06	
等于：本金	4,167,886.73	
加：应计利息	364.33	
减：坏账准备	-	
合计	5,168,466.05	

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		379,783,436.65	-	475,849,686.12	96,066,249.47
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	379,783,436.65	-	475,849,686.12	96,066,249.47

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	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37
应退替代款	393,873.22
其他应付	23,053.90

合计	496,270.28
----	------------

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	349,710,611.00	349,710,611.00
本期申购	78,000,000.00	78,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-194,000,000.00	-194,000,000.00
本期末	233,710,611.00	233,710,611.00

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	140,340,923.38	94,859,025.25	235,199,948.63
本期期初	140,340,923.38	94,859,025.25	235,199,948.63
本期利润	120,050,796.25	-5,778,833.81	114,271,962.44
本期基金份额交易产生的变动数	-67,099,648.75	-35,778,425.92	-102,878,074.67
其中：基金申购款	39,449,553.03	25,190,901.83	64,640,454.86
基金赎回款	-106,549,201.78	-60,969,327.75	-167,518,529.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	193,292,070.88	53,301,765.52	246,593,836.40

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	3,666.67
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,405.53

结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	10,072.20

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	72,373,741.15
股票投资收益——赎回差价收入	46,091,023.76
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	118,464,764.91

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	294,310,121.79
减：卖出股票成本总额	221,664,701.53
减：交易费用	271,679.11
买卖股票差价收入	72,373,741.15

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	361,518,529.53
减：现金支付赎回款总额	177,099,901.53
减：赎回股票成本总额	138,327,604.24

减：交易费用	-
赎回差价收入	46,091,023.76

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,912,821.89
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	2,912,821.89

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	-5,778,833.81
——股票投资	-5,778,833.81

——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	-5,778,833.81

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	248,013.64
合计	248,013.64

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	79,343.16

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
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
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	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	482,203,887.93	100.00%	804,806,014.90	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	93,471.23	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	155,362.51	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	1,368,666.57	3,062,899.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,212.49	30,162.78
应支付基金管理人的净管理费	1,327,454.08	3,032,737.08

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	136,866.66	306,289.96

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	952,224.00	0.41%	118,379,777.00	33.85%
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	108,135,371.00	46.27%	112,133,371.00	32.06%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	1,000,214.99	3,666.67	1,000,118.70	3,651.42

东财证券- 证券资金 户	4,168,251.06	6,405.53	21,092,307.55	20,667.81
--------------------	--------------	----------	---------------	-----------

注：1、本基金的银行存款存放在托管人中金公司在兴业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。

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

无。

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
3016 66	大普 微	2026- 04-08	6个 月	新股 限售	46.08	463.3 3	802	36,95 6.16	371,5 90.66	-
6888 08	联讯 仪器	2026- 04-16	6个 月	新股 限售	81.88	1,58 4.33	130	10,64 4.40	205,9 62.90	-
6888 18	电科 蓝天	2026- 02-03	6个 月	新股 限售	9.47	70.14	1,717	16,25 9.99	120,4 30.38	-
3016 82	宏明 电子	2026- 03-18	6个 月	新股 限售	69.66	160.0 6	572	39,84 5.52	91,55 4.32	-
6887 97	臻宝 科技	2026- 06-16	6个 月	新股 限售	44.56	468.6 7	190	8,46 6.40	89,04 7.30	-

688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股限售	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	新股限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股限售	27.19	31.31	549	14,927.31	17,189.19	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	新股限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
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	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	新股限售	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	新股限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	新股限售	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	新股限售	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股限售	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股限售	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
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	埃泰	2026-	6个	新股	33.49	33.93	72	2,41	2,44	-

93	克	04-09	月	限售				1.28	2.96	
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股限售	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股限售	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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	5,168,466.05	-	-	-	5,168,466.05
交易性 金融资 产	-	-	-	475,849,686.12	475,849,686.12

资产总计	5,168,466.05	-	-	475,849,686.12	481,018,152.17
负债					
应付清算款	-	-	-	3,413.66	3,413.66
应付管理人报酬	-	-	-	194,564.39	194,564.39
应付托管费	-	-	-	19,456.44	19,456.44
其他负债	-	-	-	496,270.28	496,270.28
负债总计	-	-	-	713,704.77	713,704.77
利率敏感度缺口	5,168,466.05	-	-	475,135,981.35	480,304,447.40
上年度末 2025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	6,008,509.86	-	-	-	6,008,509.86
交易性金融资产	-	-	-	580,303,481.54	580,303,481.54
应收清算款	-	-	-	42,774.57	42,774.57
资产总计	6,008,509.86	-	-	580,346,256.11	586,354,765.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	243,893.23	243,893.23
应付托	-	-	-	24,389.30	24,389.30

管费					
其他负债	-	-	-	1,175,923.81	1,175,923.81
负债总计	-	-	-	1,444,206.34	1,444,206.34
利率敏感度缺口	6,008,509.86	-	-	578,902,049.77	584,910,559.63

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		上年度末	
	2026年06月30日		2025年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资 产—股票投资	475,849,686.12	99.07	580,303,481.54	99.21
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	475,849,686.12	99.07	580,303,481.54	99.21

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%	23,661,064.50	28,967,599.16
	业绩比较基准下降5%	-23,661,064.50	-28,967,599.16

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	474,645,059.39	579,789,801.59
第二层次	-	-
第三层次	1,204,626.73	513,679.95
合计	475,849,686.12	580,303,481.54

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	475,849,686.12	98.93
	其中：股票	475,849,686.12	98.93
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	5,168,466.05	1.07
8	其他各项资产	-	-
9	合计	481,018,152.17	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	1,549,847.00	0.32
B	采矿业	14,599,266.60	3.04
C	制造业	357,400,029.65	74.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,527,063.00	2.40
E	建筑业	2,786,433.00	0.58
F	批发和零售业	8,979,075.00	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	5,744,682.00	1.20

H	住宿和餐饮业	343,609.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,618,896.56	6.37
J	金融业	25,946,865.22	5.40
K	房地产业	1,905,254.08	0.40
L	租赁和商务服务业	4,846,639.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	3,440,613.32	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	1,633,535.00	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,108,389.96	0.23
R	文化、体育和娱乐业	2,214,861.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	474,645,059.39	98.82

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,204,626.73	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,204,626.73	0.25

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	688498	源杰科技	4,218	7,955,148.00	1.66
2	300604	长川科技	18,600	6,350,412.00	1.32
3	001309	德明利	6,600	6,223,140.00	1.30
4	688347	华虹宏力	17,068	5,739,968.40	1.20
5	688120	华海清科	16,561	5,335,622.98	1.11
6	002281	光迅科技	20,300	5,215,882.00	1.09
7	002008	大族激光	34,600	5,193,806.00	1.08
8	300857	协创数据	14,380	4,887,762.00	1.02
9	300136	信维通信	40,600	4,841,550.00	1.01
10	688361	中科飞测	10,180	4,377,400.00	0.91

11	300475	香农芯创	13,800	4,140,000.00	0.86
12	300223	北京君正	16,300	4,057,070.00	0.84
13	002436	兴森科技	71,400	3,637,830.00	0.76
14	300285	国瓷材料	33,500	3,456,530.00	0.72
15	300054	鼎龙股份	32,000	3,391,040.00	0.71
16	600105	永鼎股份	49,100	3,313,268.00	0.69
17	300666	江丰电子	8,900	3,280,540.00	0.68
18	688200	华峰测控	5,946	3,122,244.60	0.65
19	688777	中控技术	26,527	3,116,922.50	0.65
20	300757	罗博特科	5,000	3,095,000.00	0.64
21	688037	芯源微	6,831	2,999,150.55	0.62
22	000021	深科技	46,300	2,975,701.00	0.62
23	002851	麦格米特	17,100	2,858,778.00	0.60
24	601869	长飞光纤	5,200	2,838,680.00	0.59
25	300548	长芯博创	9,900	2,752,200.00	0.57
26	002409	雅克科技	12,000	2,694,000.00	0.56
27	300346	南大光电	29,000	2,686,850.00	0.56
28	688019	安集科技	7,707	2,616,218.22	0.54
29	300567	精测电子	8,200	2,604,320.00	0.54
30	600498	烽火通信	34,200	2,517,120.00	0.52
31	002407	多氟多	50,000	2,511,500.00	0.52
32	002185	华天科技	111,600	2,489,796.00	0.52
33	002138	顺络电子	33,800	2,470,780.00	0.51
34	688313	仕佳光子	13,199	2,437,195.35	0.51
35	688002	睿创微纳	15,721	2,431,881.49	0.51
36	600879	航天电子	110,800	2,358,932.00	0.49
37	300395	菲利华	17,600	2,353,648.00	0.49
38	300620	光库科技	6,200	2,344,840.00	0.49
39	300390	天华新能	24,400	2,281,644.00	0.48
40	688017	绿的谐波	5,435	2,271,069.10	0.47
41	688469	芯联集成	211,167	2,240,481.87	0.47

42	301526	国际复材	47,500	2,216,825.00	0.46
43	300373	扬杰科技	13,700	2,154,051.00	0.45
44	300058	蓝色光标	150,700	2,073,632.00	0.43
45	002273	水晶光电	58,400	2,072,032.00	0.43
46	300037	新宙邦	22,100	2,051,985.00	0.43
47	688702	盛科通信	5,209	2,031,457.91	0.42
48	603256	宏和科技	7,600	2,016,508.00	0.42
49	688172	燕东微	23,936	2,002,485.76	0.42
50	300751	迈为股份	7,000	1,977,220.00	0.41
51	605358	立昂微	24,900	1,932,240.00	0.40
52	301377	鼎泰高科	3,500	1,928,150.00	0.40
53	600988	赤峰黄金	69,900	1,839,768.00	0.38
54	688099	晶晨股份	17,727	1,824,108.30	0.38
55	605589	圣泉集团	28,500	1,811,745.00	0.38
56	600885	宏发股份	51,900	1,790,031.00	0.37
57	002738	中矿资源	30,300	1,787,397.00	0.37
58	002126	银轮股份	35,600	1,772,880.00	0.37
59	000960	锡业股份	41,400	1,767,366.00	0.37
60	600392	盛和资源	58,900	1,753,453.00	0.37
61	600601	方正科技	125,600	1,738,304.00	0.36
62	000831	中国稀土	31,200	1,731,288.00	0.36
63	001389	广合科技	7,100	1,684,475.00	0.35
64	002812	恩捷股份	24,800	1,659,368.00	0.35
65	600141	兴发集团	35,300	1,658,041.00	0.35
66	600378	昊华科技	21,700	1,635,746.00	0.34
67	300570	太辰光	6,600	1,628,286.00	0.34
68	301358	湖南裕能	21,200	1,608,444.00	0.33
69	601179	中国西电	107,600	1,605,392.00	0.33
70	002195	岩山科技	238,000	1,556,520.00	0.32
71	688234	天岳先进	8,899	1,544,065.49	0.32
72	600497	驰宏锌锗	127,000	1,537,970.00	0.32

73	002850	科达利	8,100	1,533,330.00	0.32
74	002261	拓维信息	52,900	1,481,729.00	0.31
75	600157	永泰能源	916,100	1,474,921.00	0.31
76	688629	华丰科技	7,809	1,464,265.59	0.30
77	600711	盛屯矿业	129,800	1,423,906.00	0.30
78	002340	格林美	214,200	1,415,862.00	0.29
79	600909	华安证券	126,600	1,406,526.00	0.29
80	688052	纳芯微	4,829	1,392,248.99	0.29
81	600143	金发科技	89,800	1,387,410.00	0.29
82	300017	网宿科技	104,800	1,363,448.00	0.28
83	000783	长江证券	139,300	1,358,175.00	0.28
84	002821	凯莱英	8,380	1,357,560.00	0.28
85	003031	中瓷电子	7,500	1,352,250.00	0.28
86	002131	利欧股份	284,300	1,350,425.00	0.28
87	688411	海博思创	4,636	1,350,003.20	0.28
88	301200	大族数控	3,700	1,334,405.00	0.28
89	600352	浙江龙盛	109,300	1,323,623.00	0.28
90	601555	东吴证券	166,900	1,321,848.00	0.28
91	002203	海亮股份	57,700	1,318,445.00	0.27
92	688027	国盾量子	2,614	1,317,482.14	0.27
93	301611	珂玛科技	7,300	1,314,511.00	0.27
94	002966	苏州银行	187,700	1,306,392.00	0.27
95	601233	桐昆股份	59,900	1,296,835.00	0.27
96	688220	翱捷科技	10,429	1,296,533.28	0.27
97	603659	璞泰来	44,800	1,296,064.00	0.27
98	300339	润和软件	33,400	1,286,234.00	0.27
99	300759	康龙化成	43,400	1,255,562.00	0.26
100	688213	思特威	11,726	1,255,502.82	0.26
101	688235	百济神州	4,872	1,240,459.92	0.26
102	688578	艾力斯	11,234	1,226,752.80	0.26
103	603308	应流股份	19,900	1,201,960.00	0.25

104	688122	西部超导	19,059	1,197,095.79	0.25
105	002472	双环传动	28,600	1,187,186.00	0.25
106	601108	财通证券	136,500	1,180,725.00	0.25
107	300207	欣旺达	62,100	1,179,279.00	0.25
108	300001	特锐德	31,000	1,172,730.00	0.24
109	002517	恺英网络	71,800	1,166,750.00	0.24
110	002797	第一创业	176,500	1,159,605.00	0.24
111	002601	龙佰集团	70,100	1,155,248.00	0.24
112	300458	全志科技	29,200	1,152,232.00	0.24
113	603129	春风动力	4,500	1,151,100.00	0.24
114	601958	金钼股份	40,600	1,141,266.00	0.24
115	688387	信科移动	57,314	1,137,109.76	0.24
116	688385	复旦微电	15,790	1,125,669.10	0.23
117	300115	长盈精密	39,900	1,114,806.00	0.23
118	601198	东兴证券	81,400	1,106,226.00	0.23
119	601991	大唐发电	156,100	1,105,188.00	0.23
120	002155	湖南黄金	45,920	1,096,110.40	0.23
121	000703	恒逸石化	80,200	1,088,314.00	0.23
122	600563	法拉电子	5,700	1,087,560.00	0.23
123	688322	奥比中光	8,294	1,082,781.70	0.23
124	002465	海格通信	83,400	1,065,018.00	0.22
125	688301	奕瑞科技	8,574	1,063,176.00	0.22
126	300454	深信服	10,900	1,048,580.00	0.22
127	603179	新泉股份	21,020	1,043,643.00	0.22
128	601665	齐鲁银行	180,800	1,043,216.00	0.22
129	002056	横店东磁	34,100	1,039,368.00	0.22
130	603156	养元饮品	21,100	1,035,377.00	0.22
131	600884	杉杉股份	75,500	1,023,025.00	0.21
132	600707	彩虹股份	60,300	1,018,467.00	0.21
133	300024	机器人	52,500	1,014,825.00	0.21
134	603650	彤程新材	10,300	1,009,194.00	0.21

135	002130	沃尔核材	52,900	1,002,984.00	0.21
136	002402	和而泰	38,800	1,002,204.00	0.21
137	601162	天风证券	296,000	997,520.00	0.21
138	000060	中金岭南	130,600	988,642.00	0.21
139	002429	兆驰股份	95,100	988,089.00	0.21
140	688331	荣昌生物	7,536	981,639.36	0.20
141	300012	华测检测	70,700	979,902.00	0.20
142	688676	金盘科技	11,483	971,921.12	0.20
143	603379	三美股份	12,800	971,392.00	0.20
144	000878	云南铜业	61,100	970,268.00	0.20
145	002432	九安医疗	13,700	968,316.00	0.20
146	601099	太平洋	286,200	964,494.00	0.20
147	300496	中科创达	15,500	957,745.00	0.20
148	600109	国金证券	108,900	956,142.00	0.20
149	000893	亚钾国际	23,300	952,737.00	0.20
150	002271	东方雨虹	80,200	951,974.00	0.20
151	002414	高德红外	71,700	950,742.00	0.20
152	000034	神州数码	34,120	946,830.00	0.20
153	603688	石英股份	11,400	941,754.00	0.20
154	300623	捷捷微电	20,900	940,291.00	0.20
155	002444	巨星科技	30,100	936,110.00	0.19
156	689009	九号公司	24,520	935,438.00	0.19
157	002487	大金重工	16,100	933,317.00	0.19
158	300474	景嘉微	15,400	931,392.00	0.19
159	002335	科华数据	21,930	930,928.50	0.19
160	600256	广汇能源	187,900	928,226.00	0.19
161	603979	金诚信	15,700	926,771.00	0.19
162	000733	振华科技	16,300	923,232.00	0.19
163	600298	安琪酵母	25,500	923,100.00	0.19
164	688728	格科微	43,597	917,280.88	0.19
165	600060	海信视像	32,900	916,923.00	0.19

166	688266	泽璟制药	7,847	915,431.02	0.19
167	000661	长春高新	13,700	912,420.00	0.19
168	300763	锦浪科技	10,000	903,500.00	0.19
169	301536	星宸科技	7,000	900,970.00	0.19
170	002756	永兴材料	15,900	900,576.00	0.19
171	600021	上海电力	59,200	892,144.00	0.19
172	601128	常熟银行	153,221	891,746.22	0.19
173	300748	金力永磁	28,800	888,480.00	0.18
174	600699	均胜电子	41,000	886,010.00	0.18
175	601696	中银证券	70,000	885,500.00	0.18
176	601577	长沙银行	101,300	882,323.00	0.18
177	002078	太阳纸业	70,400	879,296.00	0.18
178	601615	明阳智能	75,900	878,163.00	0.18
179	002025	航天电器	11,500	876,530.00	0.18
180	300073	当升科技	18,200	874,328.00	0.18
181	002157	正邦科技	310,700	873,067.00	0.18
182	300142	沃森生物	67,100	871,629.00	0.18
183	603920	世运电路	18,100	869,524.00	0.18
184	300432	富临精工	43,000	863,870.00	0.18
185	300919	中伟新材	19,700	861,875.00	0.18
186	603606	东方电缆	20,740	860,917.40	0.18
187	000423	东阿阿胶	18,900	857,304.00	0.18
188	603087	甘李药业	15,100	857,076.00	0.18
189	688343	云天励飞	10,460	854,163.60	0.18
190	002252	上海莱士	193,700	840,658.00	0.18
191	688608	恒玄科技	5,001	836,117.19	0.17
192	688599	天合光能	58,911	831,823.32	0.17
193	300724	捷佳伟创	11,700	826,020.00	0.17
194	000728	国元证券	109,900	823,151.00	0.17
195	300953	震裕科技	6,100	815,570.00	0.17
196	688169	石头科技	8,583	815,127.51	0.17

197	002064	华峰化学	83,400	791,466.00	0.16
198	688375	国博电子	7,572	789,759.60	0.16
199	603119	浙江荣泰	11,900	789,446.00	0.16
200	603290	斯达半导	5,100	779,994.00	0.16
201	000786	北新建材	42,900	776,061.00	0.16
202	001203	大中矿业	25,800	772,710.00	0.16
203	002831	裕同科技	21,611	768,487.16	0.16
204	688018	乐鑫科技	5,956	761,891.52	0.16
205	600171	上海贝岭	23,800	760,172.00	0.16
206	688180	君实生物	22,438	758,853.16	0.16
207	300677	英科医疗	19,200	752,064.00	0.16
208	300383	光环新网	60,400	751,376.00	0.16
209	300679	电连技术	12,500	749,875.00	0.16
210	688187	时代电气	10,839	744,205.74	0.15
211	000519	中兵红箭	35,100	739,557.00	0.15
212	603806	福斯特	43,800	735,402.00	0.15
213	688188	柏楚电子	6,870	733,029.00	0.15
214	600177	雅戈尔	97,100	731,163.00	0.15
215	002673	西部证券	112,600	730,774.00	0.15
216	600516	方大炭素	118,300	729,911.00	0.15
217	300972	万辰集团	4,200	728,322.00	0.15
218	603160	汇顶科技	11,700	722,007.00	0.15
219	688065	凯赛生物	15,073	721,243.05	0.15
220	000559	万向钱潮	55,700	720,201.00	0.15
221	601699	潞安环能	50,300	718,284.00	0.15
222	600642	申能股份	82,200	717,606.00	0.15
223	000623	吉林敖东	40,200	712,746.00	0.15
224	002624	完美世界	57,000	707,940.00	0.15
225	600637	东方明珠	84,700	703,857.00	0.15
226	688568	中科星图	16,910	701,257.70	0.15
227	001696	宗申动力	33,600	699,216.00	0.15

228	300699	光威复材	24,400	699,060.00	0.15
229	002085	万丰奥威	62,400	692,016.00	0.14
230	603225	新凤鸣	35,200	691,680.00	0.14
231	000983	山西焦煤	119,200	691,360.00	0.14
232	000750	国海证券	187,700	690,736.00	0.14
233	300558	贝达药业	10,600	689,742.00	0.14
234	603345	安井食品	8,600	689,634.00	0.14
235	002318	久立特材	28,800	688,320.00	0.14
236	002739	儒意电影	70,900	680,640.00	0.14
237	600100	同方股份	98,400	674,040.00	0.14
238	002065	东华软件	94,200	672,588.00	0.14
239	600369	西南证券	167,300	672,546.00	0.14
240	600499	科达制造	48,300	666,540.00	0.14
241	002266	浙富控股	131,500	665,390.00	0.14
242	300627	华测导航	23,320	662,288.00	0.14
243	600595	中孚实业	117,800	662,036.00	0.14
244	002044	美年健康	131,500	661,445.00	0.14
245	600536	中国软件	23,500	660,820.00	0.14
246	603596	伯特利	26,428	656,471.52	0.14
247	603699	纽威股份	13,000	653,900.00	0.14
248	688617	惠泰医疗	3,596	652,889.76	0.14
249	688772	珠海冠宇	33,215	652,010.45	0.14
250	000629	钒钛股份	195,000	651,300.00	0.14
251	000155	川能动力	54,200	649,316.00	0.14
252	002223	鱼跃医疗	25,300	649,198.00	0.14
253	000400	许继电气	29,900	648,830.00	0.14
254	603444	吉比特	1,800	645,156.00	0.13
255	300002	神州泰岳	82,600	645,106.00	0.13
256	300003	乐普医疗	54,100	641,085.00	0.13
257	601016	节能风电	164,800	639,424.00	0.13
258	000032	深桑达 A	25,500	636,225.00	0.13

259	600985	淮北矿业	45,200	635,060.00	0.13
260	002430	杭氧股份	20,500	634,680.00	0.13
261	000415	渤海租赁	155,700	633,699.00	0.13
262	600521	华海药业	44,000	633,600.00	0.13
263	600862	中航高科	35,100	632,853.00	0.13
264	601216	君正集团	141,700	631,982.00	0.13
265	601212	白银有色	124,300	631,444.00	0.13
266	601717	中创智领	45,300	630,123.00	0.13
267	601997	贵阳银行	122,800	629,964.00	0.13
268	300487	蓝晓科技	10,700	629,695.00	0.13
269	000683	博源化工	109,300	629,568.00	0.13
270	000039	中集集团	77,300	626,903.00	0.13
271	600863	华能蒙电	131,600	618,520.00	0.13
272	603766	隆鑫通用	51,800	617,974.00	0.13
273	600704	物产中大	130,300	615,016.00	0.13
274	601001	晋控煤业	35,100	610,389.00	0.13
275	000050	深天马 A	61,400	608,474.00	0.13
276	601990	南京证券	92,400	607,068.00	0.13
277	600873	梅花生物	82,400	605,640.00	0.13
278	002841	视源股份	17,500	604,275.00	0.13
279	600312	平高电气	34,200	603,972.00	0.13
280	688538	和辉光电	231,911	602,968.60	0.13
281	603077	和邦生物	259,600	602,272.00	0.13
282	000729	燕京啤酒	59,200	599,696.00	0.12
283	603605	珀莱雅	10,000	599,200.00	0.12
284	000887	中鼎股份	33,200	593,948.00	0.12
285	000967	盈峰环境	56,400	593,892.00	0.12
286	600332	白云山	29,500	591,180.00	0.12
287	600765	中航重机	45,600	589,152.00	0.12
288	688692	达梦数据	2,398	585,807.42	0.12
289	688297	中无人机	14,093	585,564.15	0.12

290	600166	福田汽车	199,500	580,545.00	0.12
291	600153	建发股份	73,100	579,683.00	0.12
292	600348	华阳股份	75,700	579,105.00	0.12
293	000830	鲁西化工	48,000	576,000.00	0.12
294	002410	广联达	69,400	566,304.00	0.12
295	601611	中国核建	50,700	565,305.00	0.12
296	002939	长城证券	67,700	564,618.00	0.12
297	688615	合合信息	4,980	563,238.00	0.12
298	002007	华兰生物	46,000	560,740.00	0.12
299	600901	江苏金租	97,300	559,475.00	0.12
300	002683	广东宏大	19,100	559,439.00	0.12
301	000062	深圳华强	17,500	556,850.00	0.12
302	600737	中粮糖业	44,900	553,617.00	0.12
303	600578	京能电力	84,400	544,380.00	0.11
304	600363	联创光电	15,200	543,856.00	0.11
305	002926	华西证券	66,100	540,037.00	0.11
306	688582	芯动联科	8,307	539,955.00	0.11
307	603728	鸣志电器	8,800	536,096.00	0.11
308	601799	星宇股份	5,900	534,658.00	0.11
309	603568	伟明环保	34,500	530,610.00	0.11
310	688114	华大智造	10,383	530,363.64	0.11
311	000921	海信家电	19,400	530,008.00	0.11
312	000737	北方铜业	40,000	528,800.00	0.11
313	000591	太阳能	114,800	528,080.00	0.11
314	600398	海澜之家	100,800	527,184.00	0.11
315	002603	以岭药业	35,100	526,500.00	0.11
316	603298	杭叉集团	22,000	524,920.00	0.11
317	000528	柳 工	68,400	516,420.00	0.11
318	601000	唐山港	124,400	516,260.00	0.11
319	600486	扬农化工	10,130	513,591.00	0.11
320	600208	衢州发展	178,700	505,721.00	0.11

321	603341	龙旗科技	11,900	505,631.00	0.11
322	000738	航发控制	27,600	504,804.00	0.11
323	600008	首创环保	184,900	502,928.00	0.10
324	600316	洪都航空	18,000	502,920.00	0.10
325	000932	华菱钢铁	143,900	499,333.00	0.10
326	600435	北方导航	44,400	497,280.00	0.10
327	600170	上海建工	223,900	497,058.00	0.10
328	600998	九州通	105,900	496,671.00	0.10
329	688248	南网科技	7,174	496,297.32	0.10
330	600995	南网储能	40,300	495,690.00	0.10
331	000987	越秀资本	63,200	494,224.00	0.10
332	603486	科沃斯	9,700	492,275.00	0.10
333	002152	广电运通	52,100	488,698.00	0.10
334	000997	新大陆	29,700	484,110.00	0.10
335	600820	隧道股份	92,400	481,404.00	0.10
336	600161	天坛生物	41,500	480,570.00	0.10
337	002262	恩华药业	25,600	480,000.00	0.10
338	000951	中国重汽	24,600	479,946.00	0.10
339	600483	福能股份	46,700	475,873.00	0.10
340	600282	南钢股份	103,500	475,065.00	0.10
341	601106	中国一重	143,900	474,870.00	0.10
342	000009	中国宝安	75,800	472,234.00	0.10
343	603885	吉祥航空	45,800	471,282.00	0.10
344	600583	海油工程	92,800	466,784.00	0.10
345	002500	山西证券	90,400	466,464.00	0.10
346	603816	顾家家居	20,700	462,852.00	0.10
347	688295	中复神鹰	7,623	461,496.42	0.10
348	603939	益丰药房	25,500	458,490.00	0.10
349	600546	山煤国际	41,600	454,688.00	0.09
350	688778	厦钨新能	8,349	454,185.60	0.09
351	000582	北部湾港	42,200	452,806.00	0.09

352	603338	浙江鼎力	10,600	450,500.00	0.09
353	600763	通策医疗	13,192	446,944.96	0.09
354	600329	达仁堂	12,000	446,640.00	0.09
355	688166	博瑞医药	12,719	445,292.19	0.09
356	601666	平煤股份	62,200	444,730.00	0.09
357	600562	国睿科技	20,800	441,376.00	0.09
358	601567	三星电气	29,500	440,730.00	0.09
359	003022	联泓新科	16,900	437,710.00	0.09
360	600685	中船防务	17,200	437,568.00	0.09
361	002312	川发龙蟒	47,600	436,492.00	0.09
362	600602	云赛智联	27,100	435,768.00	0.09
363	600038	中直股份	17,200	434,988.00	0.09
364	600380	健康元	46,100	434,262.00	0.09
365	000723	美锦能源	129,400	433,490.00	0.09
366	688318	财富趋势	6,074	433,136.94	0.09
367	603565	中谷物流	44,100	432,621.00	0.09
368	300676	华大基因	12,300	431,238.00	0.09
369	600390	五矿资本	94,400	430,464.00	0.09
370	601156	东航物流	26,700	430,404.00	0.09
371	000513	丽珠集团	14,800	427,572.00	0.09
372	601880	辽港股份	309,200	426,696.00	0.09
373	601399	国机重装	121,200	424,200.00	0.09
374	601865	福莱特	40,000	420,400.00	0.09
375	600132	重庆啤酒	10,100	417,130.00	0.09
376	600535	天士力	31,300	414,099.00	0.09
377	600511	国药股份	15,900	414,036.00	0.09
378	600906	财达证券	54,500	406,570.00	0.08
379	688281	华秦科技	8,080	405,858.40	0.08
380	601236	红塔证券	59,400	405,108.00	0.08
381	000739	普洛药业	24,300	404,838.00	0.08
382	600977	中国电影	31,300	404,396.00	0.08

383	600816	建元信托	165,400	403,576.00	0.08
384	688336	三生国健	7,591	403,082.10	0.08
385	000598	兴蓉环境	62,700	402,534.00	0.08
386	300100	双林股份	14,400	400,032.00	0.08
387	002244	滨江集团	52,200	396,720.00	0.08
388	002299	圣农发展	26,100	395,676.00	0.08
389	600970	中材国际	55,000	392,150.00	0.08
390	601155	新城控股	38,000	389,880.00	0.08
391	600967	内蒙一机	35,700	387,345.00	0.08
392	002120	韵达股份	60,900	387,324.00	0.08
393	300735	光弘科技	17,000	386,580.00	0.08
394	300146	汤臣倍健	42,600	385,104.00	0.08
395	000883	湖北能源	89,100	384,912.00	0.08
396	300144	宋城演艺	66,100	384,041.00	0.08
397	300718	长盛轴承	6,200	378,014.00	0.08
398	688278	特宝生物	6,914	376,121.60	0.08
399	000027	深圳能源	59,900	371,380.00	0.08
400	000800	一汽解放	62,000	368,900.00	0.08
401	600131	国网信通	25,200	367,920.00	0.08
402	002568	百润股份	21,700	367,164.00	0.08
403	601608	中信重工	76,900	366,813.00	0.08
404	601866	中远海发	163,800	361,998.00	0.08
405	600095	湘财股份	48,000	361,440.00	0.08
406	003021	兆威机电	4,100	358,135.00	0.07
407	603737	三棵树	14,848	357,836.80	0.07
408	688363	华熙生物	9,999	357,664.23	0.07
409	000088	盐田港	87,300	357,057.00	0.07
410	601118	海南橡胶	71,900	353,748.00	0.07
411	600801	华新建材	22,600	352,560.00	0.07
412	002583	海能达	45,800	352,202.00	0.07
413	600126	杭钢股份	56,700	347,571.00	0.07

414	600871	石化油服	170,600	346,318.00	0.07
415	600566	济川药业	15,500	343,945.00	0.07
416	600754	锦江酒店	19,100	343,609.00	0.07
417	603000	人民网	23,200	343,128.00	0.07
418	002984	森麒麟	26,100	341,127.00	0.07
419	600517	国网英大	72,100	337,428.00	0.07
420	000709	河钢股份	173,600	336,784.00	0.07
421	600655	豫园股份	81,700	335,787.00	0.07
422	603589	口子窖	17,500	326,900.00	0.07
423	000825	太钢不锈	95,700	326,337.00	0.07
424	301606	绿联科技	5,300	323,406.00	0.07
425	600598	北大荒	29,800	323,032.00	0.07
426	603858	步长制药	22,100	322,660.00	0.07
427	601598	中国外运	64,900	321,904.00	0.07
428	001286	陕西能源	31,500	319,410.00	0.07
429	002423	中粮资本	38,700	318,501.00	0.07
430	603899	晨光股份	15,400	317,702.00	0.07
431	600350	山东高速	28,500	317,205.00	0.07
432	002773	康弘药业	15,500	316,975.00	0.07
433	688192	迪哲医药	7,880	314,648.40	0.07
434	600004	白云机场	43,300	314,358.00	0.07
435	601966	玲珑轮胎	30,700	312,833.00	0.07
436	600663	陆家嘴	49,536	311,086.08	0.06
437	600582	天地科技	69,500	309,275.00	0.06
438	688709	成都华微	8,091	308,186.19	0.06
439	688349	三一重能	20,043	304,252.74	0.06
440	600848	上海临港	40,300	301,847.00	0.06
441	000429	粤高速 A	21,900	298,935.00	0.06
442	601098	中南传媒	30,100	296,184.00	0.06
443	688563	航材股份	5,717	292,881.91	0.06
444	002508	老板电器	19,800	289,476.00	0.06

445	603233	大参林	19,100	287,073.00	0.06
446	600968	海油发展	85,400	284,382.00	0.06
447	601928	凤凰传媒	32,000	281,280.00	0.06
448	300957	贝泰妮	8,900	280,439.00	0.06
449	600062	华润双鹤	17,400	279,096.00	0.06
450	003035	南网能源	47,700	277,614.00	0.06
451	300888	稳健医疗	9,800	274,302.00	0.06
452	688561	奇安信	11,357	272,340.86	0.06
453	600688	上海石化	92,300	270,439.00	0.06
454	688425	铁建重工	67,270	270,425.40	0.06
455	601808	中海油服	24,900	269,169.00	0.06
456	002670	国盛证券	24,400	268,400.00	0.06
457	600295	鄂尔多斯	24,900	266,928.00	0.06
458	002032	苏泊尔	6,700	265,320.00	0.06
459	600098	广州发展	44,100	260,631.00	0.05
460	688708	佳驰科技	5,082	258,165.60	0.05
461	000539	粤电力 A	37,400	254,694.00	0.05
462	000537	绿发电力	34,500	252,195.00	0.05
463	600808	马钢股份	100,200	250,500.00	0.05
464	002153	石基信息	34,400	248,712.00	0.05
465	600292	电投水电	20,200	243,208.00	0.05
466	600377	宁沪高速	20,800	240,656.00	0.05
467	601298	青岛港	29,400	236,670.00	0.05
468	603833	欧派家居	7,600	228,836.00	0.05
469	000959	首钢股份	65,100	228,501.00	0.05
470	002265	建设工业	13,000	226,200.00	0.05
471	301301	川宁生物	28,100	223,114.00	0.05
472	002608	江苏国信	31,700	218,730.00	0.05
473	600339	中油工程	70,300	215,821.00	0.04
474	600606	绿地控股	177,100	214,291.00	0.04
475	600032	浙江新能	30,300	213,615.00	0.04

476	603529	爱玛科技	10,900	212,659.00	0.04
477	000785	居然智家	104,600	209,200.00	0.04
478	603658	安图生物	7,200	208,944.00	0.04
479	603786	科博达	5,100	208,641.00	0.04
480	600764	中国海防	11,900	207,417.00	0.04
481	301498	乖宝宠物	5,100	207,009.00	0.04
482	601139	深圳燃气	36,200	204,892.00	0.04
483	688520	神州细胞	5,975	204,404.75	0.04
484	000937	冀中能源	48,990	194,980.20	0.04
485	300140	节能环境	39,100	194,327.00	0.04
486	000898	鞍钢股份	100,200	187,374.00	0.04
487	603049	中策橡胶	4,100	183,721.00	0.04
488	688475	萤石网络	6,670	182,424.50	0.04
489	601228	广州港	63,300	178,506.00	0.04
490	603175	超颖电子	2,000	178,180.00	0.04
491	601019	山东出版	26,300	168,320.00	0.04
492	600927	永安期货	12,200	151,890.00	0.03
493	002945	华林证券	11,300	151,759.00	0.03
494	601112	振石股份	8,000	145,840.00	0.03
495	002461	珠江啤酒	18,500	140,045.00	0.03
496	600299	安迪苏	16,900	132,665.00	0.03
497	688819	天能股份	5,763	127,938.60	0.03
498	603092	德力佳	1,500	80,955.00	0.02
499	001221	悍高集团	1,700	68,374.00	0.01
500	001386	马可波罗	4,600	65,136.00	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	301666	大普微	802	371,590.66	0.08
2	688808	联讯仪器	130	205,962.90	0.04
3	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.03
4	301682	宏明电子	572	91,554.32	0.02
5	688797	臻宝科技	190	89,047.30	0.02
6	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
7	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
8	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
9	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
10	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
11	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
12	001365	天海电子	549	17,189.19	0.00
13	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
14	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
15	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
16	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
17	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
18	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
19	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
20	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
21	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
22	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
23	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
24	603284	林平发展	46	1,604.02	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	688498	源杰科技	6,770,522.66	1.16
2	001309	德明利	5,133,432.00	0.88
3	688361	中科飞测	3,331,440.16	0.57
4	688120	华海清科	3,245,121.90	0.55
5	300666	江丰电子	3,031,883.00	0.52
6	688525	佰维存储	2,894,459.46	0.49
7	300475	香农芯创	2,890,719.00	0.49
8	600105	永鼎股份	2,778,766.10	0.48
9	300548	长芯博创	2,490,859.00	0.43
10	601869	长飞光纤	2,454,800.00	0.42
11	688313	仕佳光子	2,365,940.44	0.40
12	300620	光库科技	2,178,097.00	0.37
13	688200	华峰测控	2,137,528.55	0.37
14	002407	多氟多	2,060,754.41	0.35
15	688037	芯源微	2,041,161.85	0.35
16	603256	宏和科技	1,949,881.00	0.33
17	688347	华虹宏力	1,816,739.62	0.31
18	301377	鼎泰高科	1,761,621.00	0.30
19	600711	盛屯矿业	1,742,465.00	0.30
20	688234	天岳先进	1,723,642.83	0.29

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	600487	亨通光电	11,963,845.00	2.05
2	688525	佰维存储	9,323,680.61	1.59
3	600549	厦门钨业	5,455,193.00	0.93
4	002353	杰瑞股份	4,353,211.00	0.74

5	301308	江波龙	4,276,434.00	0.73
6	601168	西部矿业	3,895,098.00	0.67
7	600118	中国卫星	3,785,727.85	0.65
8	688120	华海清科	3,739,254.63	0.64
9	688361	中科飞测	3,708,824.35	0.63
10	600673	东阳光	3,704,433.00	0.63
11	002156	通富微电	3,419,255.00	0.58
12	600096	云天化	3,310,798.00	0.57
13	000657	中钨高新	3,269,677.00	0.56
14	600580	卧龙电驱	3,169,851.80	0.54
15	688183	生益电子	3,102,075.74	0.53
16	688347	华虹宏力	2,906,792.22	0.50
17	603228	景旺电子	2,864,712.00	0.49
18	002837	英维克	2,415,334.60	0.41
19	000426	兴业银锡	2,398,312.00	0.41
20	002202	金风科技	2,393,038.00	0.41

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	189,312,421.16
卖出股票收入（成交）总额	294,310,121.79

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

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	股票代码	股票名称	流通受限部分的	占基金资产	流通受限情况说
---	------	------	---------	-------	---------

号			公允价值	净值比例(%)	明
1	301666	大普微	371,590.66	0.08	新股限售
2	688808	联讯仪器	205,962.90	0.04	新股限售
3	688818	电科蓝天	120,430.38	0.03	新股限售
4	301682	宏明电子	91,554.32	0.02	新股限售
5	688797	臻宝科技	89,047.30	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500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
8,104	28,838.92	125,119,704.00	53.54%	108,590,907.00	46.46%	108,135,371.00	46.27%

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500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末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	2,700.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0~10
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09月02日)基金份额总额	211,710,611.00
本报告期期初基金份额总额	349,710,611.00
本报告期基金总申购份额	78,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	194,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	233,710,611.00

§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，经基金托管人中国国际金融股份有限公司研究决定，聘任刘晴川同志为本公司资产托管部负责人，严格同志不再担任资产托管部负责人职务，公司另有任用。

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，无涉及基金财产、基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及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

本报告期内，基金托管人没有受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员没有受到调查或处罚。

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	6	482,203,887.93	100.0	93,471.23	100.0	-

证券			0%		0%	
----	--	--	----	--	----	--

- 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500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	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
5	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
6	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

7	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
8	西藏东财中证500交易型开放式指数证券投资基金2025年年度报告	证监会规定网站	2026-03-31
9	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
10	东财中证500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
11	东财中证500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
12	东财中证500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
13	东财中证500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
14	东财中证500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
15	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
16	东财中证500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
17	东财中证500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2026-03-02	118,379,777.00	46,686,190.00	164,113,743.00	952,224.00	0.41%
ETF联接基金	1	2026-01-01至2026-06-30	112,133,371.00	18,689,300.00	22,687,300.00	108,135,371.00	46.27%
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500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500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 三、《东财中证500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