

东财中证银行指数型发起式证券投资基金

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:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业银行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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	55
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	57
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东财中证银行指数型发起式证券投资基金		
基金简称	东财中证银行指数		
基金主代码	011971		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021年04月30日		
基金管理人	东财基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	60,905,436.34份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	东财中证银行指数A	东财中证银行指数C	东财中证银行指数E
下属分级基金的交易代码	011971	011972	021129
报告期末下属分级基金的份额总额	29,230,627.86份	28,399,830.80份	3,274,977.68份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争获取与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
业绩比较基准	中证银行指数收益率×95%+银行活期存款利率

	(税后) ×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东财基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾勇	冯萌
	联系电话	021-23526999	021-52629999-213310
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-9210-107	95561
传真		021-23526940	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		200030	200120
法定代表人		戴彦	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告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	东财基金管理有限公司	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)		
	东财中证银 行指数A	东财中证银 行指数C	东财中证银 行指数E
本期已实现收益	-35,334.46	-150,559.34	-25,893.38
本期利润	-3,908,121.66	-4,243,269.47	-453,711.08
加权平均基金份额本期利润	-0.1387	-0.1252	-0.1021
本期加权平均净值利润率	-10.81%	-9.95%	-8.01%
本期基金份额净值增长率	-10.72%	-10.90%	-10.90%
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	5,758,917.90	4,898,726.55	618,883.29
期末可供分配基金份额利润	0.1970	0.1725	0.1890
期末基金资产净值	34,989,545.76	33,298,557.35	3,893,860.97
期末基金份额净值	1.1970	1.1725	1.1890
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	19.70%	17.25%	22.43%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东财中证银行指数A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-8.15%	0.90%	-8.91%	0.89%	0.76%	0.01%
过去六个月	-10.72%	0.88%	-12.11%	0.88%	1.39%	0.00%
过去一年	-13.68%	0.86%	-16.66%	0.86%	2.98%	0.00%
过去三年	34.46%	0.98%	18.20%	0.97%	16.26%	0.01%
过去五年	23.64%	1.03%	-3.75%	1.03%	27.39%	0.00%
自基金合同 生效起至今	19.70%	1.02%	-6.50%	1.03%	26.20%	-0.01%

东财中证银行指数C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-8.24%	0.90%	-8.91%	0.89%	0.67%	0.01%
过去六个月	-10.90%	0.88%	-12.11%	0.88%	1.21%	0.00%
过去一年	-14.03%	0.86%	-16.66%	0.86%	2.63%	0.00%
过去三年	32.86%	0.98%	18.20%	0.97%	14.66%	0.01%
过去五年	21.20%	1.03%	-3.75%	1.03%	24.95%	0.00%
自基金合同 生效起至今	17.25%	1.02%	-6.50%	1.03%	23.75%	-0.01%

东财中证银行指数E

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	-8.24%	0.90%	-8.91%	0.89%	0.67%	0.01%
过去六个月	-10.90%	0.89%	-12.11%	0.88%	1.21%	0.01%

过去一年	-14.03%	0.86%	-16.66%	0.86%	2.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	22.43%	1.03%	12.11%	1.03%	10.32%	0.00%

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

东财中证银行指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年04月30日-2026年06月30日)



东财中证银行指数C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年04月30日-2026年06月30日)





注：1、本基金基金合同于2021年4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。

3、自2024年4月10日起，本基金增加E类份额。

§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）	证券 从业	说明
----	----	-------------------	----------	----

		期限		年限	
		任职日期	离任日期		
姚楠燕	本基金基金经理	2021-04-30	-	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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，东财中证银行指数A份额净值为1.1970元，报告期内基金份额净值增长率为-10.72%，同期业绩比较基准收益率为-12.11%；东财中证银行指数C份额净值为1.1725元，报告期内基金份额净值增长率为-10.90%，同期业绩比较基准收益率为-12.11%；东财中证银行指数E份额净值为1.1890元，报告期内基金份额净值增长率为-10.90%，同期业绩比较基准收益率为-12.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，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，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：东财中证银行指数型发起式证券投资基金

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	5,150,525.13	7,254,486.29
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	69,116,926.63	84,100,916.47
其中：股票投资		69,116,926.63	84,100,916.47
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		78,102.89	31,154.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		74,345,554.65	91,386,557.51
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		-	-
应付赎回款		1,831,586.37	2,574,068.01
应付管理人报酬		32,645.57	40,582.12
应付托管费		3,264.56	4,058.23
应付销售服务费		13,913.63	20,320.63
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	282,180.44	228,645.57
负债合计		2,163,590.57	2,867,674.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	60,905,436.34	66,726,853.37
未分配利润	6.4.7.8	11,276,527.74	21,792,029.58
净资产合计		72,181,964.08	88,518,882.95
负债和净资产总计		74,345,554.65	91,386,557.51

注：报告截止日2026年6月30日，东财中证银行指数A基金份额净值人民币1.1970元，基金份额总额29,230,627.86份；东财中证银行指数C基金份额净值人民币1.1725元，基金

份额总额28,399,830.80份；东财中证银行指数E基金份额净值人民币1.1890元，基金份额总额3,274,977.68份。基金份额总额合计为60,905,436.34份。

6.2 利润表

会计主体：东财中证银行指数型发起式证券投资基金

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		-8,205,259.55	10,796,856.83
1.利息收入		10,159.54	10,939.05
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,159.54	10,939.05
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）		116,220.43	5,721,561.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,473,308.00	3,985,431.49
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	1,589,528.43	1,736,130.50
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	-8,393,315.03	5,011,935.15

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	61,675.51	52,420.64
减：二、营业总支出		399,842.66	324,322.90
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	209,710.16	184,883.06
2.托管费	6.4.10.2.2	20,970.99	18,488.31
3.销售服务费	6.4.10.2.3	96,191.98	71,193.90
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	72,969.53	49,757.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,605,102.21	10,472,533.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,605,102.21	10,472,533.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,605,102.21	10,472,533.93

6.3 净资产变动表

会计主体：东财中证银行指数型发起式证券投资基金

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	66,726,853.37	21,792,029.58	88,518,882.95

产			
二、本期期初净资产	66,726,853.37	21,792,029.58	88,518,882.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,821,417.03	-10,515,501.84	-16,336,918.87
（一）、综合收益总额	-	-8,605,102.21	-8,605,102.21
（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）	-5,821,417.03	-1,910,399.63	-7,731,816.66
其中：1.基金申购款	103,057,252.60	27,468,591.37	130,525,843.97
2.基金赎回款	-108,878,669.63	-29,378,991.00	-138,257,660.63
（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	60,905,436.34	11,276,527.74	72,181,964.08
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	59,506,914.92	11,982,883.30	71,489,798.22
二、本期期初净资产	59,506,914.92	11,982,883.30	71,489,798.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,243,047.41	16,741,665.34	33,984,712.75

（一）、综合收益总额	-	10,472,533.93	10,472,533.93
（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）	17,243,047.41	6,269,131.41	23,512,178.82
其中：1.基金申购款	120,211,169.58	32,994,539.27	153,205,708.85
2.基金赎回款	-102,968,122.17	-26,725,407.86	-129,693,530.03
（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	76,749,962.33	28,724,548.64	105,474,510.97

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

东财中证银行指数型发起式证券投资基金（原西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金，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《西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]901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97,630,654.35份，经德勤华永会计师事务所（特

殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（21）第00192号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2021年4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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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（非标的指数成份股及其备选成份股，包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册上市的股票、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、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金股票资产投资比例为本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证银行指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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	2,621,032.99
等于：本金	2,620,776.70
加：应计利息	256.29
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	2,529,492.14
等于：本金	2,529,265.49
加：应计利息	226.65
减：坏账准备	-
合计	5,150,525.13

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		77,293,597.68	-	69,116,926.63	-8,176,671.05
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		77,293,597.68	-	69,116,926.63	-8,176,671.05

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	772.32
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	11,900.75
预提费用-信息披露费	269,507.37
合计	282,180.44

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东财中证银行指数A

金额单位：人民币元

项目 (东财中证银行指数A)	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	25,549,750.84	25,549,750.84
本期申购	28,877,015.43	28,877,015.43
本期赎回（以“-”号填列）	-25,196,138.41	-25,196,138.41
本期末	29,230,627.86	29,230,627.86

6.4.7.7.2 东财中证银行指数C

金额单位：人民币元

项目 (东财中证银行指数C)	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	37,010,486.17	37,010,486.17
本期申购	59,491,049.73	59,491,049.73
本期赎回（以“-”号填列）	-68,101,705.10	-68,101,705.10
本期末	28,399,830.80	28,399,830.80

6.4.7.7.3 东财中证银行指数E

金额单位：人民币元

项目 (东财中证银行指数E)	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	4,166,616.36	4,166,616.36
本期申购	14,689,187.44	14,689,187.44
本期赎回（以“-”号填列）	-15,580,826.12	-15,580,826.12
本期末	3,274,977.68	3,274,977.68

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东财中证银行指数A

单位：人民币元

项目 (东财中证银行指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,671,911.97	2,034,215.60	8,706,127.57
本期期初	6,671,911.97	2,034,215.60	8,706,127.57
本期利润	-35,334.46	-3,872,787.20	-3,908,121.66
本期基金份额交易产生的变动数	957,277.47	3,634.52	960,911.99
其中：基金申购款	7,568,945.99	639,649.23	8,208,595.22
基金赎回款	-6,611,668.52	-636,014.71	-7,247,683.23
本期已分配利润	-	-	-

本期末	7,593,854.98	-1,834,937.08	5,758,917.90
-----	--------------	---------------	--------------

6.4.7.8.2 东财中证银行指数C

单位：人民币元

项目 (东财中证银行指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,832,889.15	2,859,681.72	11,692,570.87
本期期初	8,832,889.15	2,859,681.72	11,692,570.87
本期利润	-150,559.34	-4,092,710.13	-4,243,269.47
本期基金份额交易产生的变动数	-2,013,592.52	-536,982.33	-2,550,574.85
其中：基金申购款	14,230,905.54	980,726.02	15,211,631.56
基金赎回款	-16,244,498.06	-1,517,708.35	-17,762,206.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,668,737.29	-1,770,010.74	4,898,726.55

6.4.7.8.3 东财中证银行指数E

单位：人民币元

项目 (东财中证银行指数E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	884,609.07	508,722.07	1,393,331.14
本期期初	884,609.07	508,722.07	1,393,331.14
本期利润	-25,893.38	-427,817.70	-453,711.08
本期基金份额交易产生的变动数	-176,106.86	-144,629.91	-320,736.77
其中：基金申购款	3,133,348.97	915,015.62	4,048,364.59
基金赎回款	-3,309,455.83	-1,059,645.53	-4,369,101.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	682,608.83	-63,725.54	618,883.29

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	5,056.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,102.59
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	10,159.54

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	43,975,776.90
减：卖出股票成本总额	45,405,662.17
减：交易费用	43,422.73
买卖股票差价收入	-1,473,308.00

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期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	1,589,528.43
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	1,589,528.43

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	-8,393,315.03
——股票投资	-8,393,315.03
——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	-8,393,315.03

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	58,790.15
转换费收入	2,885.36
合计	61,675.51

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	11,900.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,561.41
合计	72,969.53

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、基金注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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
上海天天基金销售有限公司（“天天基金”）	与管理人受同一实际控制人控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	82,736,652.90	100.00%	96,819,407.89	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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

		例		
东财证券	16,128.75	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	18,882.60	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管理费	209,710.16	184,883.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	101,030.03	74,987.64
应支付基金管理人的净管理费	108,680.13	109,895.42

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	20,970.99	18,488.31

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东财中证银行指数 A	东财中证银行指数 C	东财中证银行指数 E	合计
兴业银行	0.00	5,464.07	0.00	5,464.07
天天基金	0.00	62,719.33	4,987.31	67,706.64
东财证券	0.00	1,355.81	460.22	1,816.03
合计	0.00	69,539.21	5,447.53	74,986.74
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	东财中证银行指数 A	东财中证银行指数 C	东财中证银行指数 E	合计
兴业银行	0.00	7,268.20	0.00	7,268.20
天天基金	0.00	44,944.43	2,242.12	47,186.55
东财证券	0.00	974.23	170.40	1,144.63
东财基金	0.00	0.00	3,313.77	3,313.77

管理有限 公司				
合计	0.00	53,186.86	5,726.29	58,913.15

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类和E类基金份额的销售服务费年费率为0.40%，按前一日该类基金份额基金资产净值的0.40%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。销售服务费的计算方法如下：

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

H为该类基金份额每日应计提的销售服务费
E为该类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

东财中证银行指数A

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	-	11,037,410.60

报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	11,037,410.60
报告期末持有的基金份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

东财中证银行指数C

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

东财中证银行指数E

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	-	1,496,008.02
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	1,496,008.02
报告期末持有的基金份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

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

2、申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

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

东财中证银行指数A

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	1,835,124.58	6.28%	1,925,124.58	7.53%

东财中证银行指数C

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
-	-	-	-	-

东财中证银行指数E

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
-	-	-	-	-

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
兴业银行-托管户	2,621,032.99	5,056.95	2,740,200.86	4,654.30
东财证券-证券资金户	2,529,492.14	5,102.59	3,948,460.22	6,284.75

注：1、本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

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托管人兴业银行股份有限公司发行的证券（601166）409,600股，市值为人民币6,782,976.00元，占本基金净资产的比例为9.40%。（于上年度末：持有438,600股，市值为人民币9,236,916.00元，占本基金净资产的比例10.43%。）

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
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股限售	17.70	84.32	61	1,079.70	5,143.52	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股限售	13.86	73.46	61	845.46	4,481.06	-

603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股限售	15.76	46.71	41	646.16	1,915.11	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股限售	11.18	17.59	84	939.12	1,477.56	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股限售	21.88	25.52	33	722.04	842.16	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股限售	37.88	34.87	18	681.84	627.66	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股限售	33.49	33.93	17	569.33	576.81	-

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	5,150,525.13	-	-	-	5,150,525.13
交易性金融资产	-	-	-	69,116,926.63	69,116,926.63
应收申购款	-	-	-	78,102.89	78,102.89
资产总计	5,150,525.13	-	-	69,195,029.52	74,345,554.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,831,586.37	1,831,586.37
应付管理人报酬	-	-	-	32,645.57	32,645.57
应付托管费	-	-	-	3,264.56	3,264.56
应付销售服务费	-	-	-	13,913.63	13,913.63
其他负债	-	-	-	282,180.44	282,180.44
负债总计	-	-	-	2,163,590.57	2,163,590.57
利率敏感度缺口	5,150,525.13	-	-	67,031,438.95	72,181,964.08
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	7,254,486.29	-	-	-	7,254,486.29
交易性金融资产	-	-	-	84,100,916.47	84,100,916.47

应收申购款	-	-	-	31,154.75	31,154.75
资产总计	7,254,486.29	-	-	84,132,071.22	91,386,557.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,574,068.01	2,574,068.01
应付管理人报酬	-	-	-	40,582.12	40,582.12
应付托管费	-	-	-	4,058.23	4,058.23
应付销售服务费	-	-	-	20,320.63	20,320.63
其他负债	-	-	-	228,645.57	228,645.57
负债总计	-	-	-	2,867,674.56	2,867,674.56
利率敏感度缺口	7,254,486.29	-	-	81,264,396.66	88,518,882.95

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	69,116,926.63	95.75	84,100,916.47	95.01
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	69,116,926.63	95.75	84,100,916.47	95.01

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	上年度末
		2026年06月30日	2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	3,575,361.04	4,389,134.51
	业绩比较基准下降5%	-3,575,361.04	-4,389,134.51

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	69,101,862.75	84,084,152.57
第二层次	-	-
第三层次	15,063.88	16,763.90
合计	69,116,926.63	84,100,916.47

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	69,116,926.63	92.97
	其中：股票	69,116,926.63	92.97
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	5,150,525.13	6.93
8	其他各项资产	78,102.89	0.11
9	合计	74,345,554.65	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	69,101,862.75	95.73
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	69,101,862.75	95.73

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	15,063.88	0.02
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	15,063.88	0.02

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	600036	招商银行	290,492	10,312,466.00	14.29
2	601166	兴业银行	409,600	6,782,976.00	9.40
3	601398	工商银行	782,800	5,534,396.00	7.67
4	601288	农业银行	695,200	4,219,864.00	5.85
5	601328	交通银行	645,400	4,149,922.00	5.75
6	600919	江苏银行	355,200	3,829,056.00	5.30
7	600000	浦发银行	322,300	2,775,003.00	3.84
8	002142	宁波银行	79,860	2,371,043.40	3.28
9	000001	平安银行	234,800	2,359,740.00	3.27
10	601229	上海银行	240,610	2,088,494.80	2.89
11	601988	中国银行	346,400	1,981,408.00	2.75
12	601939	建设银行	205,000	1,974,150.00	2.73
13	600016	民生银行	600,600	1,933,932.00	2.68
14	600926	杭州银行	122,800	1,774,460.00	2.46
15	601169	北京银行	358,100	1,754,690.00	2.43
16	601009	南京银行	149,600	1,479,544.00	2.05
17	601658	邮储银行	266,800	1,315,324.00	1.82
18	601818	光大银行	449,100	1,297,899.00	1.80
19	601838	成都银行	61,500	1,088,550.00	1.51
20	601825	沪农商行	140,000	1,048,600.00	1.45
21	600015	华夏银行	154,000	984,060.00	1.36
22	601916	浙商银行	364,920	959,739.60	1.33
23	601998	中信银行	128,200	888,426.00	1.23
24	601077	渝农商行	128,400	784,524.00	1.09
25	002966	苏州银行	108,140	752,654.40	1.04
26	601665	齐鲁银行	104,200	601,234.00	0.83
27	601128	常熟银行	88,220	513,440.40	0.71
28	601577	长沙银行	58,400	508,664.00	0.70
29	601997	贵阳银行	70,800	363,204.00	0.50
30	002958	青农商行	107,500	294,550.00	0.41
31	002948	青岛银行	51,230	260,248.40	0.36

32	002807	江阴银行	65,490	242,967.90	0.34
33	601187	厦门银行	31,900	217,877.00	0.30
34	601528	瑞丰银行	47,470	209,817.40	0.29
35	603323	苏农银行	53,760	208,051.20	0.29
36	601963	重庆银行	19,800	199,584.00	0.28
37	002936	郑州银行	119,745	197,579.25	0.27
38	001227	兰州银行	96,500	193,000.00	0.27
39	600908	无锡银行	37,200	188,976.00	0.26
40	002839	张家港行	47,320	184,548.00	0.26
41	601860	紫金银行	70,900	171,578.00	0.24
42	600928	西安银行	32,300	105,621.00	0.15

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	603459	红板科技	61	5,143.52	0.01
2	603407	长裕集团	61	4,481.06	0.01
3	603435	嘉德利	41	1,915.11	0.00
4	601112	振石股份	84	1,477.56	0.00
5	603352	至信股份	33	842.16	0.00
6	603284	林平发展	18	627.66	0.00
7	603293	埃泰克	17	576.81	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	600036	招商银行	6,074,791.00	6.86

2	601166	兴业银行	3,944,384.00	4.46
3	601398	工商银行	2,954,914.00	3.34
4	601288	农业银行	2,413,189.00	2.73
5	601328	交通银行	2,249,386.00	2.54
6	600919	江苏银行	1,938,703.00	2.19
7	600000	浦发银行	1,647,049.00	1.86
8	000001	平安银行	1,326,077.00	1.50
9	002142	宁波银行	1,255,076.00	1.42
10	601229	上海银行	1,180,817.00	1.33
11	600016	民生银行	1,152,951.00	1.30
12	600926	杭州银行	1,021,704.00	1.15
13	601988	中国银行	993,399.00	1.12
14	601169	北京银行	977,391.00	1.10
15	601939	建设银行	974,810.00	1.10
16	601009	南京银行	838,535.00	0.95
17	601818	光大银行	752,557.00	0.85
18	601658	邮储银行	696,982.00	0.79
19	601825	沪农商行	620,461.00	0.70
20	601916	浙商银行	560,759.00	0.63

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	600036	招商银行	6,308,202.00	7.13
2	601166	兴业银行	4,496,716.00	5.08
3	601398	工商银行	3,383,983.00	3.82
4	601288	农业银行	2,741,378.00	3.10
5	601328	交通银行	2,589,013.82	2.92

6	600919	江苏银行	2,269,789.00	2.56
7	600000	浦发银行	1,882,013.00	2.13
8	000001	平安银行	1,511,457.00	1.71
9	002142	宁波银行	1,438,700.00	1.63
10	601229	上海银行	1,351,601.00	1.53
11	600016	民生银行	1,317,419.00	1.49
12	600926	杭州银行	1,173,379.00	1.33
13	601988	中国银行	1,148,403.00	1.30
14	601939	建设银行	1,137,990.00	1.29
15	601169	北京银行	1,117,207.00	1.26
16	601009	南京银行	978,071.00	1.10
17	601818	光大银行	851,472.00	0.96
18	601658	邮储银行	794,138.00	0.90
19	601825	沪农商行	714,788.00	0.81
20	601916	浙商银行	643,155.00	0.73

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	38,814,987.36
卖出股票收入（成交）总额	43,975,776.90

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。

兴业银行：2025年12月19日，国家金融监督管理总局对兴业银行股份有限公司处以行政处罚。

工商银行：2026年6月5日，国家金融监督管理总局对中国工商银行股份有限公司处以行政处罚。2025年12月10日，中国人民银行对中国工商银行股份有限公司处以行政处罚。

农业银行：2025年10月31日，国家金融监督管理总局对中国农业银行股份有限公司处以行政处罚。

交通银行：2026年6月5日，国家金融监督管理总局对交通银行股份有限公司处以行政处罚。2025年12月10日，中国人民银行对交通银行股份有限公司处以行政处罚。

浦发银行：2026年2月12日，中国人民银行对上海浦东发展银行股份有限公司处以行政处罚。2025年10月31日和2025年12月19日，国家金融监督管理总局对上海浦东发展银行股份有限公司处以行政处罚。

平安银行：2025年10月31日，国家金融监督管理总局对平安银行股份有限公司处以行政处罚。

上海银行：2026年1月28日，国家金融监督管理总局上海监管局对上海银行股份有限公司处以行政处罚。2025年7月21日，中国人民银行对上海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银行指数，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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	78,102.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,102.89

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	603459	红板科技	5,143.52	0.01	新股限售

2	603407	长裕集团	4,481.06	0.01	新股限售
3	603435	嘉德利	1,915.11	0.00	新股限售
4	601112	振石股份	1,477.56	0.00	新股限售
5	603352	至信股份	842.16	0.00	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

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
东财 中证 银行 指数A	2,231	13,102.03	1,835,124.58	6.28%	27,395,503.28	93.72%
东财 中证 银行 指数C	3,762	7,549.13	0.00	0.00%	28,399,830.80	100.00%
东财 中证 银行 指数E	882	3,713.13	0.00	0.00%	3,274,977.68	100.00%
合计	6,592	9,239.30	1,835,124.58	3.01%	59,070,311.76	96.99%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即

期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东财中证银行指数A	4,758.08	0.02%
	东财中证银行指数C	22.56	0.00%
	东财中证银行指数E	216.23	0.01%
	合计	4,996.87	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	东财中证银行指数A	0~10
	东财中证银行指数C	0
	东财中证银行指数E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东财中证银行指数A	0
	东财中证银行指数C	0
	东财中证银行指数E	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金基金合同生效届满三年，发起份额已全部赎回。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东财中证银行指数 A	东财中证银行指数 C	东财中证银行指数 E
基金合同生效日(2021年04月30日)基金份额总额	53,537,508.51	44,093,145.84	-
本报告期期初基金份额总额	25,549,750.84	37,010,486.17	4,166,616.36
本报告期基金总申购份额	28,877,015.43	59,491,049.73	14,689,187.44
减：本报告期基金总赎回份额	25,196,138.41	68,101,705.10	15,580,826.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,230,627.86	28,399,830.80	3,274,977.68

§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：报告期内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。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

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无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

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无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	4	82,736,652.90	100.00%	16,128.75	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	西藏东财中证银行指数型发起式证券投资基金2025年第4季度报告	证监会规定网站	2026-01-22
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	西藏东财中证银行指数型发	证监会规定网站	2026-03-31

	起式证券投资基金2025年年度报告		
8	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
9	东财中证银行指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-04-03
10	东财中证银行指数型发起式证券投资基金托管协议	证监会规定网站	2026-04-03
11	东财中证银行指数型发起式证券投资基金基金合同	证监会规定网站	2026-04-03
12	东财中证银行指数型发起式证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2026-04-03
13	东财中证银行指数型发起式证券投资基金2026年第1季度报告	证监会规定网站	2026-04-21
14	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
15	东财中证银行指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-06-27
16	东财中证银行指数型发起式证券投资基金招募说明书更新	证监会规定网站	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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

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