

西部利得量化成长混合型发起式证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 25 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	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	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金	
基金简称	西部利得量化成长混合	
基金主代码	000006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年3月19日	
基金管理人	西部利得基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	725,398,645.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
下属分级基金的交易代码	000006	011228
报告期末下属分级基金的份额总额	698,754,333.53份	26,644,312.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化投资策略进行股票投资，在严格控制风险和保持资产高流动性的前提下，努力实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要通过多因子量化投资模型，选取并持有具有成长性的股票构成投资组合，打造成长风格，力争稳定的超越业绩基准的投资收益。（详见《基金合同》）
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*75%+同期银行活期存款利率（税后）*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，在通常情况下其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	西部利得基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵毅
	联系电话	021-38572888
	电子邮箱	service@westleadfund.com
客户服务电话	4007-007-818	95599
传真	021-38572750	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200126	100031
法定代表人	何方	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人处——上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	西部利得基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区耀体路 276 号 901 室-908 室

§ 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(2021年1月1日-2021年6月30日)		
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	
本期已实现收益	162,266,307.40	3,472,569.06	
本期利润	266,850,622.59	6,189,649.64	
加权平均基金份额本期利润	0.4003	0.4224	
本期加权平均净值利润率	19.07%	20.02%	
本期基金份额净值增长率	21.25%	15.38%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)		
	期末可供分配利润	618,203,253.56	23,369,732.57
	期末可供分配基金份额利润	0.8847	0.8771
	期末基金资产净值	1,683,463,664.12	63,971,844.17
	期末基金份额净值	2.4092	2.4010

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	152.47%	15.38%

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（除暂估附加税）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与本期暂估附加税费的合计值。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

西部利得量化成长混合 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
过去一个月	7.70%	1.31%	0.90%	0.54%	6.80%	0.77%
过去三个月	21.98%	1.10%	6.63%	0.51%	15.35%	0.59%
过去六个月	21.25%	1.38%	5.31%	0.74%	15.94%	0.64%
过去一年	57.41%	1.42%	12.34%	0.94%	45.07%	0.48%
自基金合同生效起至今	152.47%	1.36%	18.83%	1.06%	133.64%	0.30%

西部利得量化成长混合 C

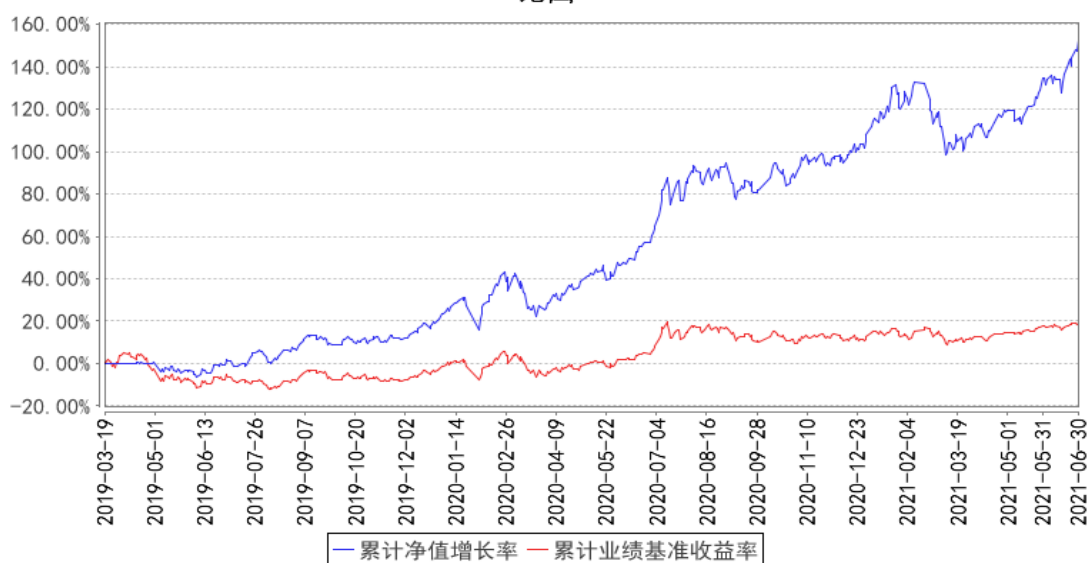
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.63%	1.31%	0.90%	0.54%	6.73%	0.77%

过去三个月	21.75%	1.10%	6.63%	0.51%	15.12%	0.59%
自基金合同生效起 至今	15.38%	1.39%	3.17%	0.74%	12.21%	0.65%

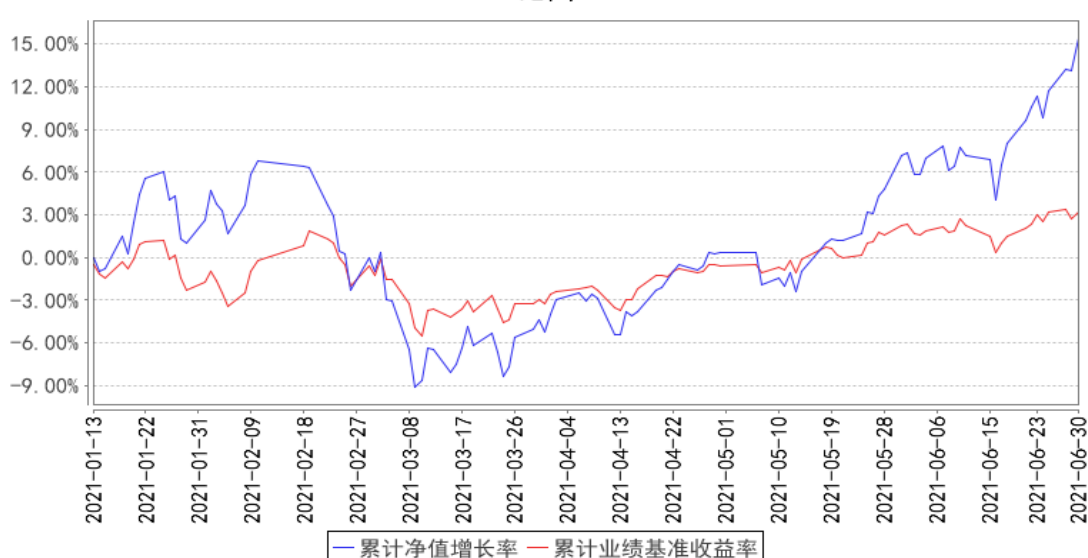
注：本基金的业绩基准为：中证 500 指数收益率*75%+同期银行活期存款利率（税后）*25%

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

西部利得量化成长混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



西部利得量化成长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西部利得基金管理有限公司于 2010 年 7 月 20 日正式成立，公司总部设在上海，在北京、深圳设有分公司，注册资本人民币 35000.00 万元整，是经中国证监会批准设立的第 60 家全国规范性基金管理公司，自成立以来逐步成长为一家以绝对收益产品为特色的资产管理人。目前公司拥有公募基金、特定客户资产管理业务、受托管理保险资金等资格。

公司在“绝对收益”领域采取稳步推进策略，已发展为一家以固收+和量化指数投资为特色、以主动管理权益和混合资产投资为驱动的多元化资产管理公司。致力成为行业基础产品供应商。西部利得基金始终将投资人利益放首位，为投资人提供多样化的资产配置解决方案。

公司一直坚持“专业、诚信”的经营理念，成立至今已发行了货币型、债券型、混合型、指数型、股票型等多种类型的基金产品共 49 只，形成了较为完善的产品线，满足不同风险偏好的投资者需求。

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		
盛丰衍	公募量化投资部副总经理、基金经理	2019 年 3 月 19 日	-	8 年	复旦大学计算机应用技术硕士，曾任光大证券股份有限公司权益投资助理、上海光大证券资产管理有限公司研究员、兴证证券资产管理有限公司量化研究员。2016 年 10 月加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。
陈元骅	基金经理助理	2020 年 11 月 13 日	-	5 年	美国哥伦比亚大学金融数学硕士，曾任中信建投证券股份有限公司研究发展部金融工程分析师。2020 年 5 月 28 日加入本公司，具有基金从业资格，中国国籍。

注：1. 任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无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

本报告期内，本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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

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

投资策略上，本基金始终维持高股票仓位，持仓的三个特征为中频、中盘、成长，行业配置参考中证 500 指数，市值上相对于基准存在大市值暴露，股票持仓分散以此弱化个股黑天鹅的影响。基金经理对自己能力的认知是：优选股票最易，风格判断其次，而择时最难。只有在择时可能带来极高赔率的情况下，克制而谦逊的择时才会带来部分超额收益。本基金努力通过选股获得相对于中证 500 指数的超额收益，以期打造成长风格的优质量化基金，在接下去的投资管理中会坚持类似的投资风格。

感谢持有人的支持，我们将继续以诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，努力为持有人带来优异回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内基金业绩表现参见本报告第三部分“主要财务指标和基金净值表现”。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年三季度，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是外需持续高景气+通胀若隐若现的宏观背景。

第二季度的 PMI 新订单、新出口订单、工业生产、投资、社融、房企资金来源等多项反映经济运行指标出现下滑；外需持续高景气，并且可能继续超预期；大宗商品价格通胀指数则处于近几

年高位。几项因素叠加后对 A 股影响略偏负面。因子配置上需要兼顾高成长和低估值。

其二上市公司二、三季度盈利增速。

财报期，上市公司盈利增速是 A 股行业配置的重要参考指标。2021 年 Q2 和 Q3 的上市公司盈利增速可能是未来造成 A 股板块间差异的主要原因之一。

其三是核心资产偏好的降温。

以茅指数为代表的核心资产在过去 4 年中持续战胜以中证 500 指数为代表的中盘股。这一趋势在今年 2 月下旬戛然而止。春节后，中盘股相对于大盘股表现出持续的超额收益。这个趋势可能还将持续一个季度。做出这一预判的线索有三，中证 500 指数历史估值分位数明显低于沪深 300 指数估值历史分位数；今年 2 月和 3 月核心资产的大幅回撤中断了核心资产的趋势交易；雪球结构、量化私募产品、公募新发基金、保险等机构调整持仓似乎都更偏好于中盘股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和程序，并经本基金管理人总经理办公会议审议通过成立了估值委员会。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。具体职责包括对本基金管理人估值政策和程序的制订和解释；在发生影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况，以及在采用新投资策略或投资新品种时，估值委员会负责对所采用的估值模型、假设及参数的适当性进行重新评估或修订，必要时聘请会计师事务所进行审核并出具意见。针对个别投资品种的估值方法调整，均须通过托管银行复核。

估值委员会的成员包括投资管理部、风险控制岗、监察稽核部、基金运营部等有关人员组成。基金经理如认为持仓品种的估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，通过参与对估值问题的讨论和与估值委员会共同商定估值原则和政策等方式，对估值议案提出反馈意见。作为公司估值委员会委员，基金经理有权投票表决有关议案。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

可参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

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，本基金未出现连续二十个工作日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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—西部利得基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，西部利得基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，西部利得基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	111,193,408.01	99,522,862.55
结算备付金		18,641,115.27	7,514,372.42
存出保证金		2,473,303.27	1,416,929.01
交易性金融资产	6.4.7.2	1,608,784,458.99	1,008,803,420.60
其中：股票投资		1,608,784,458.99	1,007,803,520.60
基金投资		-	-
债券投资		-	999,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,016,268.63	2,851,837.10
应收利息	6.4.7.5	31,507.80	44,709.66
应收股利		-	-
应收申购款		21,920,993.96	5,298,690.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,767,061,055.93	1,125,452,822.13
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		2,685,629.90	18,228,642.18
应付赎回款		11,959,850.60	2,821,673.99
应付管理人报酬		1,963,360.05	1,300,313.44
应付托管费		130,890.65	86,687.60
应付销售服务费		29,605.57	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,617,264.52	1,335,580.35
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	238,946.35	194,980.97
负债合计		19,625,547.64	23,967,878.53
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	725,398,645.80	554,341,578.83
未分配利润	6.4.7.10	1,022,036,862.49	547,143,364.77
所有者权益合计		1,747,435,508.29	1,101,484,943.60
负债和所有者权益总计		1,767,061,055.93	1,125,452,822.13

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，西部利得量化成长混合 A 基金份额净值为 2.4092 元，基金份额总额为 698,754,333.53 份；西部利得量化成长混合 C 基金份额净值为 2.4010 元，基金份额总额为 26,644,312.27 份。西部利得量化成长混合基金总份额为 725,398,645.80 份。

6.2 利润表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		295,318,627.71	57,347,331.66
1. 利息收入		514,255.45	68,925.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	513,586.91	64,758.49
债券利息收入		668.54	4,166.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		185,878,770.11	38,614,218.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	178,004,137.22	37,163,484.17
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	149,580.47	76,087.36
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-988,791.51	-
股利收益	6.4.7.16	8,713,843.93	1,374,647.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	107,301,395.77	18,497,745.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,624,206.38	166,442.17
减：二、费用		22,278,355.48	2,729,574.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,652,675.59	1,252,891.75
2. 托管费	6.4.10.2.2	710,178.33	83,526.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	115,493.61	-
4. 交易费用	6.4.7.19	10,681,443.00	1,300,647.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		673.46	135.47
7. 其他费用	6.4.7.20	117,891.49	92,373.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		273,040,272.23	54,617,757.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		273,040,272.23	54,617,757.58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	554,341,578.83	547,143,364.77	1,101,484,943.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	273,040,272.23	273,040,272.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	171,057,066.97	201,853,225.49	372,910,292.46
其中：1. 基金申购款	384,386,537.40	437,919,627.91	822,306,165.31
2. 基金赎回款	-213,329,470.43	-236,066,402.42	-449,395,872.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	725,398,645.80	1,022,036,862.49	1,747,435,508.29
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	114,940,759.86	24,371,536.29	139,312,296.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,617,757.58	54,617,757.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	138,780,139.07	74,235,526.09	213,015,665.16

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	200,307,419.06	94,683,759.24	294,991,178.30
2. 基金赎回款	-61,527,279.99	-20,448,233.15	-81,975,513.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	253,720,898.93	153,224,819.96	406,945,718.89

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：

贺燕萍

贺燕萍

张皞骏

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

西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金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[2018]第 189 号《关于准予西部利得量化阿尔法混合型证券投资基金变更注册的批复》核准,由西部利得基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 177,836,375.57 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 1900164 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 177,856,344.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 19,968.52 份基金份额。本基金的基金管理人为西部利得基金管理有限公司,基金托管人为中国农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》和《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资

券(含超短期融资券)、中期票据、资产支持证券、次级债券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、权证、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相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%。基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;本基金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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率*75%+同期银行活期存款利率(税后)*25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策和会计估计变更。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《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》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	111,193,408.01
定期存款	-
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	-
合计	111,193,408.01

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,415,980,113.16	1,608,784,458.99	192,804,345.83
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	1,415,980,113.16	1,608,784,458.99	192,804,345.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	11,967,280.00	-	-	
其中：股指期货投资	11,967,280.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	11,967,280.00	-	-	

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

股指期货投资明细如下：

本期末 2021 年 6 月 30 日，金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2107	中证 500 期货 2107	9.00	12,180,960.00	213,680.00
总额合计				213,680.00
减：可抵消期货暂收款				-213,680.00
股指期货投资净额				-

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	28,017.60
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,199.40
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	290.80
合计	31,507.80

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,617,264.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,617,264.52

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24,726.80
应付证券出借违约金	-
预提费用	214,219.55
合计	238,946.35

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得量化成长混合 A

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	554,341,578.83	554,341,578.83
本期申购	351,759,748.04	351,759,748.04
本期赎回 (以“-”号填列)	-207,346,993.34	-207,346,993.34
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	698,754,333.53	698,754,333.53

西部利得量化成长混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	32,626,789.36	32,626,789.36
本期赎回 (以“-”号填列)	-5,982,477.09	-5,982,477.09
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	26,644,312.27	26,644,312.27

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

西部利得量化成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	357,471,865.51	189,671,499.26	547,143,364.77
本期利润	162,266,307.40	104,584,315.19	266,850,622.59
本期基金份额交易产生的变动数	98,465,080.65	72,250,262.58	170,715,343.23
其中：基金申购款	259,021,141.15	141,184,351.11	400,205,492.26
基金赎回款	-160,556,060.50	-68,934,088.53	-229,490,149.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	618,203,253.56	366,506,077.03	984,709,330.59

西部利得量化成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-	-	-
本期利润	3,472,569.06	2,717,080.58	6,189,649.64
本期基金份额交易产生的变动数	19,897,163.51	11,240,718.75	31,137,882.26
其中：基金申购款	24,636,001.80	13,078,133.85	37,714,135.65
基金赎回款	-4,738,838.29	-1,837,415.10	-6,576,253.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,369,732.57	13,957,799.33	37,327,531.90

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入		444,141.42
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		57,487.30
其他		11,958.19
合计		513,586.91

注：其他包括结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		178,004,137.22
股票投资收益——赎回差价收入		-
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		178,004,137.22

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,713,828,651.27
减：卖出股票成本总额	4,535,824,514.05
买卖股票差价收入	178,004,137.22

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无股票出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	149,580.47
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	149,580.47

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,219,056.49
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,046,786.23
减：应收利息总额	22,689.79
买卖债券差价收入	149,580.47

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期内未有资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内未持有贵金属。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内未持有权证。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	-988,791.51

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,713,843.93
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	8,713,843.93

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	107,201,715.77
股票投资	107,201,815.77
债券投资	-100.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	99,680.00
权证投资	-
期货投资	99,680.00
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	107,301,395.77

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,619,595.45
基金转换费收入	4,610.93
合计	1,624,206.38

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	10,681,443.00
银行间市场交易费用	-
合计	10,681,443.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行费用	23,271.94
其他	400.00
合计	117,891.49

6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金合同》、《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金招募说明书》、《西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金分红公告》规定，基金管理人西部利得基金管理有限公司于 2021 年 7 月 26 日(权益登记日)，对本基金进行了分红除权。分红结果如下：权益登记日 2021 年 7 月 26 日，除息日 2021 年 7 月 26 日，现金红利发放日 2021 年 7 月 28 日，每 10 份西部利得量化成长混合 A 基金份额分红人民币 1.2000 元，每 10 份西部利得量化成长混合 C 基金份额分红人民币 1.2000 元。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，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
西部利得基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
西部证券股份有限公司	基金管理人的股东
利得科技有限公司	基金管理人的股东

注：以下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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,652,675.59	1,252,891.75
其中：支付销售机构的客户维护费	1,601,813.01	148,774.02

注：支付基金管理人西部利得基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	710,178.33	83,526.11
----------------	------------	-----------

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	合计
中国农业银行	-	0.00	0.00
西部利得基金	-	75,539.70	75,539.70
西部证券	-	0.00	0.00
合计	-	75,539.70	75,539.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：

(1) 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给西部利得基金，再由西部利得基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

(2) 本基金于上年度可比期间未发生应支付关联方的销售服务费。

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与关联方进行银行间同业市场的债券(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进行转融通证券出借业务。

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进行转融通证券出借业务。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月13日（基金合同生效日）至2021年6月30日
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日（2019年3月19日）持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期间申购/买入总份额	4.71	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,604.71	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.3786%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	-
	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日（2019年3月19日）持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期初持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,600.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.9416%	-

注：本基金本报告期及上年可比期间基金管理人未运用自有资金投资量化成长 C。

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

西部利得量化成长混合 A

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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 (%)
西部证券股份有限公司	2,711,766.77	0.3738	2,711,766.77	0.4892

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资西部利得量化成长混合 C。

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	111,193,408.01	444,141.42	34,299,913.76	54,550.90

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金通过“中国农业银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2021年06月30日的相关余额为人民币7,109,866.29元。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021年6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	可流通日	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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	锁定期	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	锁定期	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	锁定期	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月20日	锁定期	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	锁定期	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	锁定期	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	锁定期	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	锁定期	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	锁定期	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	锁定期	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	锁定期	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月	锁定期	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-

		日	10日							
300948	冠中生态	2021年 2月18 日	2021 年8月 25日	锁定期	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年 2月24 日	2021 年9月 3日	锁定期	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021年 3月3 日	2021 年9月 13日	锁定期	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021年 3月11 日	2021 年9月 22日	锁定期	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年 3月16 日	2021 年9月 24日	锁定期	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021 年9月 27日	锁定期	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021年 3月18 日	2021 年9月 29日	锁定期	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021 年9月 29日	锁定期	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年 3月23 日	2021 年9月 30日	锁定期	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021 年10 月11 日	锁定期	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年 3月30 日	2021 年10 月11 日	锁定期	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年 3月31 日	2021 年10 月11 日	锁定期	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年 4月2 日	2021 年10 月13 日	锁定期	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	锁定期	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	锁定期	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	锁定期	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	锁定期	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	锁定期	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	锁定期	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	锁定期	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	锁定期	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	锁定期	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	锁定期	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	锁定期	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300992	泰福	2021年	2021	锁定期	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

	泵业	5月17日	年11月25日							
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	锁定期	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	锁定期	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	锁定期	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	锁定期	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	锁定期	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	锁定期	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	锁定期	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	锁定期	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	锁定期	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	锁定期	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	锁定期	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

			日								
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-	
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	锁定期	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-	
301020	C密封	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-	
301021	C英诺	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-	
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-	
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-	
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-	
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-	
688345	博力威	2021年6月3日	2021年12月13日	锁定期	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	-	
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-	
688538	和辉光电	2021年5月20日	2021年11月29日	锁定期	2.65	3.38	368,328	976,069.20	1,244,948.64	-	
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年7月7日	锁定期	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	-	

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	-------	-------	--------	--------	----

				价		价				
688368	晶丰明源	2021年6月21日	重大事项停牌	335.26	2021年7月5日	402.31	47,400	14,921,897.14	15,891,324.00	-

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人实行全员参与的全面风险管理，董事会及其下设合规审核委员会、监事会、经营管理层及其下设合规及风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部、各业务部门和分支机构均根据公司制度规定履行各自的风险管理职责。

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建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；银行存款均存放于信用良好的银行；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完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	999,900.00
合计	-	999,900.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债、超短期融资券等无信用评级的债券

6.4.13.3 流动性风险

本基金的基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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、存出保证金和结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	111,193,408.01	-	-	-	111,193,408.01
结算备付金	18,641,115.27	-	-	-	18,641,115.27
存出保证金	2,473,303.27	-	-	-	2,473,303.27
交易性金融资产	-	-	-	1,608,784,458.99	1,608,784,458.99
应收利息	-	-	-	31,507.80	31,507.80
应收申购款	-	-	-	21,920,993.96	21,920,993.96
应收证券清算款	-	-	-	4,016,268.63	4,016,268.63
资产总计	132,307,826.55	-	-	1,634,753,229.38	1,767,061,055.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,959,850.60	11,959,850.60
应付管理人报酬	-	-	-	1,963,360.05	1,963,360.05
应付托管费	-	-	-	130,890.65	130,890.65
应付证券清算款	-	-	-	2,685,629.90	2,685,629.90
应付销售服务费	-	-	-	29,605.57	29,605.57
应付交易费用	-	-	-	2,617,264.52	2,617,264.52
其他负债	-	-	-	238,946.35	238,946.35
负债总计	-	-	-	19,625,547.64	19,625,547.64
利率敏感度缺口	132,307,826.55	-	-	-1,615,127,681.74	1,747,435,508.29
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	99,522,862.55	-	-	-	99,522,862.55
结算备付金	7,514,372.42	-	-	-	7,514,372.42
存出保证金	1,416,929.01	-	-	-	1,416,929.01
交易性金融资产	999,900.00	-	-	-1,007,803,520.60	1,008,803,420.60
应收利息	-	-	-	44,709.66	44,709.66
应收申购款	-	-	-	5,298,690.79	5,298,690.79
应收证券清算款	-	-	-	2,851,837.10	2,851,837.10
资产总计	109,454,063.98	-	-	-1,015,998,758.15	1,125,452,822.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,821,673.99	2,821,673.99
应付管理人报酬	-	-	-	1,300,313.44	1,300,313.44
应付托管费	-	-	-	86,687.60	86,687.60
应付证券清算款	-	-	-	18,228,642.18	18,228,642.18
应付交易费用	-	-	-	1,335,580.35	1,335,580.35
其他负债	-	-	-	194,980.97	194,980.97
负债总计	-	-	-	23,967,878.53	23,967,878.53
利率敏感度缺口	109,454,063.98	-	-	992,030,879.62	1,101,484,943.60

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的债券投资占基金资产净值的比例小于 20%（2020 年 12 月 31 日小于 20%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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	1,608,784,458.99	92.07	1,007,803,520.60	91.49
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	999,900.00	0.09
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	1,608,784,458.99	92.07	1,008,803,420.60	91.59

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		
	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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
分析	业绩比较基准上升 5%	98,695,000.00	58,973,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-98,695,000.00	-58,973,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属

于第一层级的余额 1589831306.95 元，属于第二层级的余额为 18953152.04 元，无属于第三层级的余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额 996942625.56 元，属于第二层级的余额为 10860895.04 元，无属于第三层级的余额）。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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	1,608,784,458.99	91.04
	其中：股票	1,608,784,458.99	91.04
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	129,834,523.28	7.35
8	其他各项资产	28,442,073.66	1.61
9	合计	1,767,061,055.93	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	31,653,010.00	1.81
C	制造业	1,322,758,346.27	75.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	27,403,223.80	1.57
G	交通运输、仓储和邮政业	40,258,261.08	2.30
H	住宿和餐饮业	5,729,170.00	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,118,693.36	4.58
J	金融业	14,821,690.22	0.85
K	房地产业	14,434,200.00	0.83
L	租赁和商务服务业	8,894,076.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	31,566,982.98	1.81
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	22,302,536.16	1.28
R	文化、体育和娱乐业	5,907,336.75	0.34
S	综合	2,842,812.00	0.16
	合计	1,608,784,458.99	92.07

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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

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	300671	富满电子	170,100	22,391,964.00	1.28
2	688699	明微电子	73,058	20,844,908.56	1.19
3	605111	新洁能	108,500	19,559,295.00	1.12
4	300327	中颖电子	221,600	18,886,968.00	1.08
5	603659	璞泰来	138,260	18,886,316.00	1.08
6	603026	石大胜华	116,200	18,830,210.00	1.08
7	002876	三利谱	287,600	18,607,720.00	1.06

8	688029	南微医学	58,600	18,265,034.00	1.05
9	603008	喜临门	553,300	18,264,433.00	1.05
10	002154	报喜鸟	2,849,100	18,148,767.00	1.04
11	300124	汇川技术	239,850	17,811,261.00	1.02
12	300724	捷佳伟创	151,900	17,621,919.00	1.01
13	603260	合盛硅业	229,000	17,612,390.00	1.01
14	603290	斯达半导	55,000	17,600,000.00	1.01
15	603733	仙鹤股份	462,000	17,556,000.00	1.00
16	603392	万泰生物	67,600	17,520,568.00	1.00
17	300769	德方纳米	84,300	17,423,967.00	1.00
18	688116	天奈科技	147,000	17,346,000.00	0.99
19	601636	旗滨集团	934,000	17,335,040.00	0.99
20	603486	科沃斯	75,400	17,197,232.00	0.98
21	603678	火炬电子	254,132	17,153,910.00	0.98
22	300373	扬杰科技	283,200	17,144,928.00	0.98
23	003022	联泓新科	556,730	17,091,611.00	0.98
24	688016	心脉医疗	37,500	17,047,875.00	0.98
25	002985	北摩高科	174,670	17,030,325.00	0.97
26	300034	钢研高纳	524,598	16,897,301.58	0.97
27	300015	爱尔眼科	237,792	16,878,476.16	0.97
28	002709	天赐材料	158,002	16,839,853.16	0.96
29	002026	山东威达	1,210,900	16,540,894.00	0.95
30	002812	恩捷股份	70,000	16,387,000.00	0.94
31	600132	重庆啤酒	82,500	16,330,875.00	0.93
32	300679	电连技术	565,201	16,289,092.82	0.93
33	002614	奥佳华	708,000	16,022,040.00	0.92
34	600845	宝信软件	312,929	15,928,086.10	0.91
35	688368	晶丰明源	47,400	15,891,324.00	0.91
36	300394	天孚通信	619,686	15,690,449.52	0.90
37	300593	新雷能	360,653	15,670,372.85	0.90
38	300696	爱乐达	374,010	15,566,296.20	0.89
39	002920	德赛西威	140,200	15,433,216.00	0.88
40	000830	鲁西化工	822,800	15,411,044.00	0.88
41	300009	安科生物	1,001,980	14,929,502.00	0.85
42	002738	中矿资源	334,700	14,860,680.00	0.85
43	300737	科顺股份	471,200	14,814,528.00	0.85
44	603877	太平鸟	275,000	14,679,500.00	0.84
45	600499	科达制造	1,016,800	14,641,920.00	0.84
46	000615	奥园美谷	656,100	14,434,200.00	0.83
47	300755	华致酒行	349,500	14,263,095.00	0.82
48	002240	盛新锂能	471,205	13,452,902.75	0.77
49	603128	华贸物流	949,410	13,377,186.90	0.77

50	600711	盛屯矿业	1,859,200	13,256,096.00	0.76
51	000807	云铝股份	1,111,200	13,223,280.00	0.76
52	601678	滨化股份	1,669,397	13,204,930.27	0.76
53	300463	迈克生物	307,900	12,959,511.00	0.74
54	002645	华宏科技	802,500	12,823,950.00	0.73
55	002833	弘亚数控	330,900	12,822,375.00	0.73
56	000933	神火股份	1,333,800	12,604,410.00	0.72
57	603337	杰克股份	463,661	12,393,658.53	0.71
58	300529	健帆生物	143,000	12,349,480.00	0.71
59	603489	八方股份	52,100	12,315,398.00	0.70
60	000887	中鼎股份	1,000,300	12,083,624.00	0.69
61	600028	中国石化	2,568,200	11,197,352.00	0.64
62	002756	永兴材料	185,900	11,040,601.00	0.63
63	600586	金晶科技	1,180,000	10,985,800.00	0.63
64	603259	药明康德	64,322	10,072,181.98	0.58
65	002925	盈趣科技	254,580	9,905,707.80	0.57
66	600688	上海石化	2,549,600	9,586,496.00	0.55
67	600581	八一钢铁	1,545,500	9,551,190.00	0.55
68	605399	晨光新材	398,300	9,364,033.00	0.54
69	000825	太钢不锈	1,237,900	9,271,871.00	0.53
70	601005	重庆钢铁	3,432,500	9,164,775.00	0.52
71	300059	东方财富	274,328	8,995,215.12	0.51
72	300119	瑞普生物	260,500	8,810,110.00	0.50
73	603657	春光科技	262,600	8,442,590.00	0.48
74	605369	拱东医疗	72,800	8,373,456.00	0.48
75	002791	坚朗五金	41,600	8,072,480.00	0.46
76	601012	隆基股份	90,860	8,072,002.40	0.46
77	688068	热景生物	42,032	7,944,048.00	0.45
78	603919	金徽酒	190,100	7,816,912.00	0.45
79	603305	旭升股份	231,100	7,795,003.00	0.45
80	603906	龙蟠科技	222,600	7,791,000.00	0.45
81	300750	宁德时代	14,400	7,701,120.00	0.44
82	002080	中材科技	285,400	7,468,918.00	0.43
83	300747	锐科激光	64,400	7,345,464.00	0.42
84	300568	星源材质	174,130	7,203,758.10	0.41
85	300014	亿纬锂能	67,100	6,973,703.00	0.40
86	002594	比亚迪	27,700	6,952,700.00	0.40
87	002967	广电计量	158,200	6,929,160.00	0.40
88	688357	建龙微纳	62,800	6,904,860.00	0.40
89	002648	卫星石化	175,885	6,892,933.15	0.39
90	603728	鸣志电器	387,500	6,816,125.00	0.39
91	688085	三友医疗	156,200	6,815,006.00	0.39

92	603456	XD 九洲药	138,000	6,704,040.00	0.38
93	300767	震安科技	80,080	6,650,644.00	0.38
94	002759	天际股份	178,400	6,627,560.00	0.38
95	603799	华友钴业	58,010	6,624,742.00	0.38
96	300595	欧普康视	62,700	6,492,585.00	0.37
97	003020	立方制药	124,500	6,374,400.00	0.36
98	605099	共创草坪	150,200	6,365,476.00	0.36
99	002283	天润工业	1,148,300	6,361,582.00	0.36
100	603916	苏博特	305,680	6,309,235.20	0.36
101	300012	华测检测	191,200	6,095,456.00	0.35
102	300101	振芯科技	337,700	6,048,207.00	0.35
103	603466	风语筑	361,305	5,907,336.75	0.34
104	000858	五粮液	19,700	5,868,433.00	0.34
105	601111	中国国航	741,300	5,767,314.00	0.33
106	603885	吉祥航空	376,643	5,747,572.18	0.33
107	600754	锦江酒店	100,600	5,729,170.00	0.33
108	300753	爱朋医疗	247,056	5,588,406.72	0.32
109	601888	中国中免	18,600	5,581,860.00	0.32
110	002429	兆驰股份	915,200	5,555,264.00	0.32
111	603986	兆易创新	29,540	5,550,566.00	0.32
112	601021	春秋航空	95,600	5,439,640.00	0.31
113	601003	柳钢股份	890,200	5,252,180.00	0.30
114	300453	三鑫医疗	337,050	5,247,868.50	0.30
115	600199	金种子酒	318,700	5,204,371.00	0.30
116	300618	寒锐钴业	63,900	5,037,876.00	0.29
117	002609	捷顺科技	500,700	5,012,007.00	0.29
118	688202	美迪西	9,400	4,887,060.00	0.28
119	603186	华正新材	133,600	4,871,056.00	0.28
120	600516	方大炭素	645,000	4,798,800.00	0.27
121	601702	华峰铝业	657,300	4,633,965.00	0.27
122	002245	蔚蓝锂芯	230,900	4,548,730.00	0.26
123	600966	博汇纸业	347,700	4,537,485.00	0.26
124	603198	迎驾贡酒	100,900	4,469,870.00	0.26
125	000906	浙商中拓	339,963	4,399,121.22	0.25
126	600809	山西汾酒	9,800	4,390,400.00	0.25
127	603826	坤彩科技	115,000	4,361,950.00	0.25
128	600329	中新药业	154,200	4,331,478.00	0.25
129	300871	回盛生物	106,850	4,167,150.00	0.24
130	600779	水井坊	32,400	4,093,740.00	0.23
131	600085	同仁堂	98,800	4,035,980.00	0.23
132	002182	云海金属	336,300	4,028,874.00	0.23
133	603979	金诚信	217,708	3,918,744.00	0.22

134	300763	锦浪科技	21,590	3,899,154.00	0.22
135	688408	中信博	18,900	3,795,120.00	0.22
136	003012	东鹏控股	224,100	3,729,024.00	0.21
137	601919	中远海控	120,300	3,673,962.00	0.21
138	002371	北方华创	13,200	3,661,416.00	0.21
139	002043	兔宝宝	370,400	3,652,144.00	0.21
140	000301	东方盛虹	174,100	3,638,690.00	0.21
141	002459	晶澳科技	74,200	3,635,800.00	0.21
142	300782	卓胜微	6,700	3,601,250.00	0.21
143	603127	昭衍新药	19,500	3,583,125.00	0.21
144	603236	移远通信	21,000	3,582,810.00	0.21
145	300316	晶盛机电	70,300	3,550,150.00	0.20
146	002223	鱼跃医疗	92,600	3,530,838.00	0.20
147	688680	海优新材	13,600	3,495,200.00	0.20
148	603806	福斯特	33,200	3,490,316.00	0.20
149	600763	通策医疗	8,400	3,452,400.00	0.20
150	002568	百润股份	36,400	3,450,356.00	0.20
151	603027	千禾味业	129,800	3,412,442.00	0.20
152	601238	广汽集团	262,500	3,399,375.00	0.19
153	603501	韦尔股份	10,500	3,381,000.00	0.19
154	601688	华泰证券	213,500	3,373,300.00	0.19
155	000100	TCL 科技	434,600	3,324,690.00	0.19
156	002010	传化智联	429,600	3,312,216.00	0.19
157	000625	长安汽车	125,500	3,298,140.00	0.19
158	002049	紫光国微	21,300	3,284,247.00	0.19
159	601699	潞安环能	277,800	3,280,818.00	0.19
160	601633	长城汽车	74,900	3,264,891.00	0.19
161	000725	京东方 A	521,000	3,251,040.00	0.19
162	601058	赛轮轮胎	318,600	3,182,814.00	0.18
163	688586	江航装备	113,173	3,155,263.24	0.18
164	002831	裕同科技	106,200	3,153,078.00	0.18
165	603208	江山欧派	31,800	2,988,882.00	0.17
166	002798	帝欧家居	182,618	2,845,188.44	0.16
167	000009	中国宝安	155,600	2,842,812.00	0.16
168	300390	天华超净	58,900	2,828,967.00	0.16
169	000733	振华科技	45,700	2,790,899.00	0.16
170	002651	利君股份	223,900	2,706,951.00	0.15
171	601211	国泰君安	141,100	2,418,454.00	0.14
172	603915	国茂股份	60,000	2,370,000.00	0.14
173	688157	松井股份	19,000	2,368,540.00	0.14
174	002221	东华能源	207,400	2,271,030.00	0.13
175	603639	海利尔	124,905	2,247,040.95	0.13

176	603737	三棵树	12,180	2,143,680.00	0.12
177	002626	金达威	47,600	2,127,720.00	0.12
178	300729	乐歌股份	84,240	2,015,863.20	0.12
179	300347	泰格医药	10,200	1,971,660.00	0.11
180	300570	太辰光	111,195	1,779,120.00	0.10
181	600269	赣粤高速	507,100	1,703,856.00	0.10
182	000799	酒鬼酒	6,500	1,661,400.00	0.10
183	300458	全志科技	18,800	1,648,008.00	0.09
184	002853	皮阿诺	68,050	1,471,921.50	0.08
185	688526	科前生物	40,000	1,448,800.00	0.08
186	603995	甬金股份	36,600	1,407,270.00	0.08
187	688538	和辉光电	368,328	1,244,948.64	0.07
188	603638	艾迪精密	22,260	954,286.20	0.05
189	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.04
190	600808	马钢股份	140,600	603,174.00	0.03
191	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
192	300919	中伟股份	1,220	198,860.00	0.01
193	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.01
194	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
195	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
196	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
197	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
198	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
199	301020	C 密封	4,210	44,794.40	0.00
200	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
201	301021	C 英诺	2,899	27,424.54	0.00
202	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
203	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
204	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
205	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
206	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
207	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
208	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
209	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
210	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
211	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
212	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
213	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
214	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
215	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
216	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
217	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00

218	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
219	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
220	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
221	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
222	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
223	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
224	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
225	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
226	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
227	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
228	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
229	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
230	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
231	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
232	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
233	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
234	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
235	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
236	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
237	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
238	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
239	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
240	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
241	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
242	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
243	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
244	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
245	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
246	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
247	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
248	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
249	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
250	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
251	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
252	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
253	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
254	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	000830	鲁西化工	38,304,106.17	3.48
2	300408	三环集团	37,579,033.00	3.41
3	002614	奥佳华	33,568,357.23	3.05
4	600702	舍得酒业	31,406,958.26	2.85
5	300737	科顺股份	30,043,090.80	2.73
6	603026	石大胜华	30,003,702.20	2.72
7	300015	爱尔眼科	29,393,008.98	2.67
8	002791	坚朗五金	29,156,572.72	2.65
9	605111	新洁能	27,940,445.40	2.54
10	300782	卓胜微	27,736,766.00	2.52
11	603906	龙蟠科技	27,207,118.04	2.47
12	300373	扬杰科技	27,106,679.36	2.46
13	688202	美迪西	26,536,032.60	2.41
14	300783	三只松鼠	25,896,788.00	2.35
15	603486	科沃斯	25,888,195.00	2.35
16	000933	神火股份	25,083,909.00	2.28
17	002158	汉钟精机	25,046,370.30	2.27
18	002139	拓邦股份	25,019,509.00	2.27
19	600711	盛屯矿业	25,005,331.63	2.27
20	601636	旗滨集团	24,952,658.84	2.27
21	000568	泸州老窖	24,925,194.00	2.26
22	603127	昭衍新药	24,530,941.79	2.23
23	601233	桐昆股份	23,831,803.00	2.16
24	300463	迈克生物	23,528,025.02	2.14
25	601311	XD 骆驼股	23,508,727.30	2.13
26	300529	健帆生物	23,220,542.50	2.11
27	002812	恩捷股份	23,183,815.83	2.10
28	002138	顺络电子	22,866,912.86	2.08
29	002726	龙大肉食	22,663,878.71	2.06
30	300623	捷捷微电	22,191,128.38	2.01

注：本表“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）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	300408	三环集团	43,405,697.30	3.94
2	002139	拓邦股份	36,956,833.07	3.36
3	600702	舍得酒业	34,044,680.60	3.09
4	000568	泸州老窖	32,277,242.21	2.93
5	002158	汉钟精机	31,421,014.75	2.85

6	601799	星宇股份	29,023,464.00	2.63
7	000830	鲁西化工	28,932,291.70	2.63
8	603486	科沃斯	28,188,885.60	2.56
9	601311	XD 骆驼股	25,618,924.56	2.33
10	688111	金山办公	25,230,611.04	2.29
11	603939	益丰药房	25,189,641.18	2.29
12	603026	石大胜华	24,851,999.23	2.26
13	002138	顺络电子	24,746,071.72	2.25
14	601233	桐昆股份	24,315,201.50	2.21
15	002614	奥佳华	24,308,081.30	2.21
16	688202	美迪西	24,114,743.46	2.19
17	002271	东方雨虹	23,490,874.31	2.13
18	300413	芒果超媒	23,376,447.88	2.12
19	300783	三只松鼠	23,369,141.01	2.12
20	603906	龙蟠科技	23,096,366.00	2.10
21	300782	卓胜微	22,619,791.35	2.05
22	600409	三友化工	22,401,373.00	2.03
23	002230	科大讯飞	22,086,520.80	2.01

注：本表“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）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	5,029,603,636.67
卖出股票收入（成交）总额	4,713,828,651.27

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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。

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

本基金于本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量（买/ 卖）	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2107	IC2107	9	12,180,960.0 0	213,680.00	-
公允价值变动总额合计（元）					213,680.00
股指期货投资本期收益（元）					-988,791.51
股指期货投资本期公允价值变动（元）					99,680.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不在本基金投资范围内。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金于本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不在本基金投资范围内。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有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	2,473,303.27
2	应收证券清算款	4,016,268.63
3	应收股利	-

4	应收利息	31,507.80
5	应收申购款	21,920,993.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,442,073.66

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，本报告中涉及比例计算的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（%）
西部利得量化成长混合 A	22,787	30,664.60	515,682,542.86	73.80	183,071,790.67	26.20
西部利得量化成长	1,799	14,810.62	16,938,796.66	63.57	9,705,515.61	36.43

混合 C						
合计	24,295	29,857.94	532,621,339.52	73.42	192,777,306.28	26.58

注：1. “持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额；

2. 分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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）。

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	西部利得量化成长混合 A	2,033,205.74	0.2910
	西部利得量化成长混合 C	2,615.28	0.0098
	合计	2,035,821.02	0.2806

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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）。

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	西部利得量化成长混合 A	10~50
	西部利得量化成长混合 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得量化成长混合 A	>100
	西部利得量化成长混合 C	-
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总	发起份额总数	发起份额占基金总份额	发起份额承诺持有期限

		份额比例 (%)		比例(%)	
基金管理人固有资金	10,000,604.71	1.38	10,000,604.71	1.38	36 个月
基金管理人高级管理人员	474,914.94	0.07	-	-	-
基金经理等人员	177,947.09	0.02	-	-	-
基金管理人股东	2,711,766.77	0.37	-	-	-
其他	1,410,536.20	0.19	-	-	-
合计	14,775,769.71	2.04	10,000,604.71	1.38	-

注：持有份额占基金总份额比例合计=14,775,769.71/725,398,645.8 =2.04%，与各列求和有尾差 0.01%。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得量化成长混合 A	西部利得量化成长混合 C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 19 日) 基金份额总额	177,856,344.09	-
本报告期期初基金份额总额	554,341,578.83	-
本报告期基金总申购份额	351,759,748.04	32,626,789.36
减：本报告期基金总赎回份额	207,346,993.34	5,982,477.09
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	698,754,333.53	26,644,312.27

注：其中“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开本基金份额持有人大会，无基金份额持有人大会决议。

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

基金管理人于 2021 年 1 月 7 日对外发布了公司董事及独立董事变更公告，董事长为何方先生、股东董事为李兴春先生、曲莉女士，当然董事为贺燕萍女士，独立董事为张成虎先生、吴弘先生；于 2021 年 1 月 11 日对外发布了公司高级管理人员变更公告，任命王宇、孙威、蔡晨研为公司副总经理。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金进行审计。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	4,185,246,847.41	43.00%	1,805,113.44	35.64%	-
海通证券	2	3,248,423,009.72	33.37%	1,725,890.42	34.08%	-
方正证券	2	741,129,020.43	7.61%	393,769.27	7.77%	-
湘财证券	2	606,187,438.13	6.23%	443,312.40	8.75%	-
光大证券股份有限公司	1	522,534,340.40	5.37%	382,130.11	7.54%	-
国信证券	2	430,173,907.52	4.42%	314,586.93	6.21%	-

银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：(1) 资力雄厚，信誉良好；(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；(3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
长江证券	228,882.99	19.13%	-	-	-	-
海通证券	967,673.50	80.87%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	关于西部利得量化成长混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同相应条款的公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2021 年 1 月 12 日
2	西部利得基金管理有限公司基金管理人住所变更公告	同上	2021 年 7 月 2 日

§ 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

截止本报告期末，本基金未出现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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准本基金设立的相关文件；
- (2) 本基金《基金合同》；
- (3) 本基金《招募说明书》；
- (4) 本基金《托管协议》；
- (5) 基金管理人《基金管理资格证书》及《企业法人营业执照》；
- (6) 报告期内本基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

本基金管理人处——上海市浦东新区耀体路 276 号晶耀商务广场 3 号楼 9 层

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资人可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.westleadfund.com> 投资人对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人西部利得基金管理有限公司，咨询电话 4007-007-818（免长途话费）或发电子邮件，E-mail:service@westleadfund.com。

西部利得基金管理有限公司

2021 年 8 月 30 日