

西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：西部利得基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	70
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	70
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	71
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末上市基金前十名持有人	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
9.4 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	73
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	77
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	500 增强 LOF	
基金主代码	502000	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2020 年 2 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	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	1,616,536,789.46 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2020 年 2 月 19 日	
下属分级基金的基 金简称	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
下属分级基金的场 内简称	500 增强 LOF	-
下属分级基金的交 易代码	502000	009300
报告期末下属分级 基金的份额总额	1,206,051,730.27 份	410,485,059.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金 80%以上非现金资产投资于中证 500 指数成分股，维持高股票仓位，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，兼顾安全边际以及业绩的成长性，以期获得相

	对于该指数的超额收益。(详见《基金合同》)
业绩比较基准	本基金的标的指数为: 中证 500 指数 本基金业绩比较基准为: 中证 500 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金, 其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金, 主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现, 具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		西部利得基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵毅	林兴盛
	联系电话	021-38572888	021-52629999-213707
	电子邮箱	service@westleadfund.com	linxingsheng@cib.com.cn
客户服务电话		4007-007-818	95561
传真		021-38572750	021-62159217
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区耀 体路 276 号 901 室-908 室	福州市湖东路 154 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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		200126	200120
法定代表人		何方	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	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.westleadfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特 殊普通合伙)	北京市长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2021 年	2020 年 2 月 19 日 (基金合同生效 日)-2020 年 12 月 31 日	2020 年 4 月 13 日 (基金合同生效 日)-2020 年 12 月 31 日
--------------------------	--------	--	--

	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	187,668,823.58	61,527,990.68	112,554,364.37	7,011,788.93
本期利润	225,163,056.49	71,051,380.38	149,761,363.53	7,213,628.92
加权平均基金份额本期利润	0.2856	0.2566	0.4566	0.4132
本期加权平均净值利润率	16.07%	14.12%	37.91%	30.74%
本期基金份额净值增长率	27.70%	27.20%	45.72%	56.17%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	81,645,202.15	220,611,433.20	-78,553,740.13	16,082,853.04
期末可供分配基金份额利润	0.0677	0.5374	-0.2252	0.2525
期末基金资产净值	2,244,355,469.87	758,818,042.12	508,209,340.13	92,583,289.32
期末基金份额净值	1.8609	1.8486	1.4572	1.4533
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	86.09%	98.65%	45.72%	56.17%

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

西部利得中证 500 指数增强 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	-0.85%	0.95%	3.43%	0.72%	-4.28%	0.23%
过去六个月	8.75%	1.21%	7.72%	0.91%	1.03%	0.30%
过去一年	27.70%	1.23%	14.83%	0.92%	12.87%	0.31%
自基金合同生效起至今	86.09%	1.35%	28.58%	1.19%	57.51%	0.16%

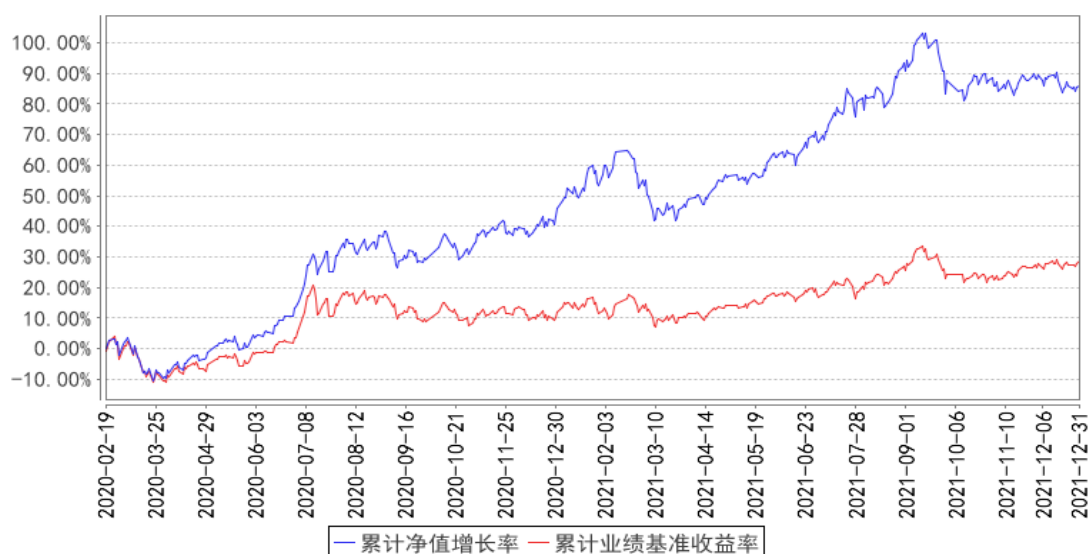
西部利得中证 500 指数增强 C

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	-0.95%	0.95%	3.43%	0.72%	-4.38%	0.23%
过去六个月	8.54%	1.21%	7.72%	0.91%	0.82%	0.30%

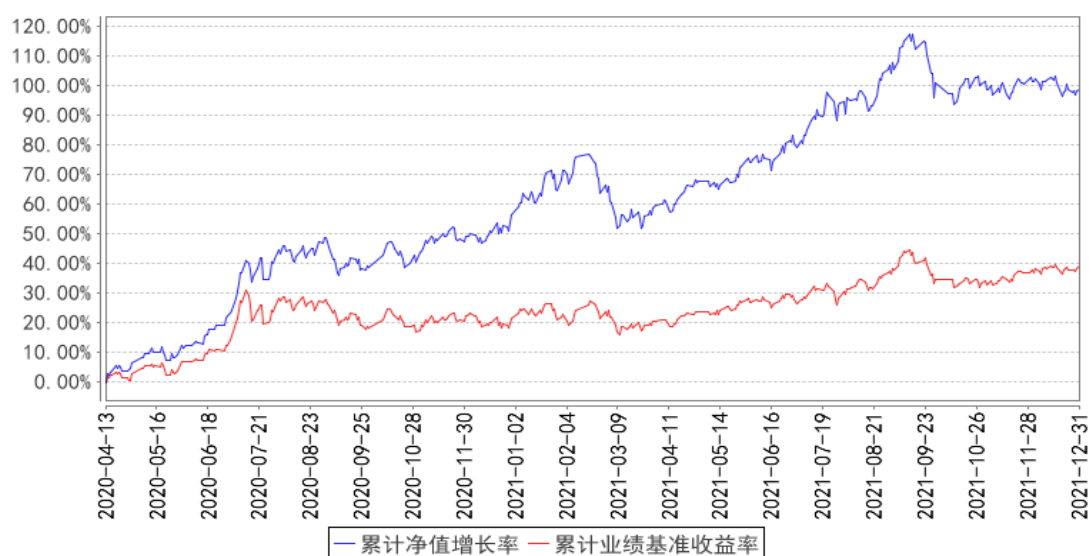
过去一年	27.20%	1.23%	14.83%	0.92%	12.37%	0.31%
自基金合同生效起 至今	98.65%	1.27%	39.10%	1.08%	59.55%	0.19%

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

西部利得中证500指数增强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

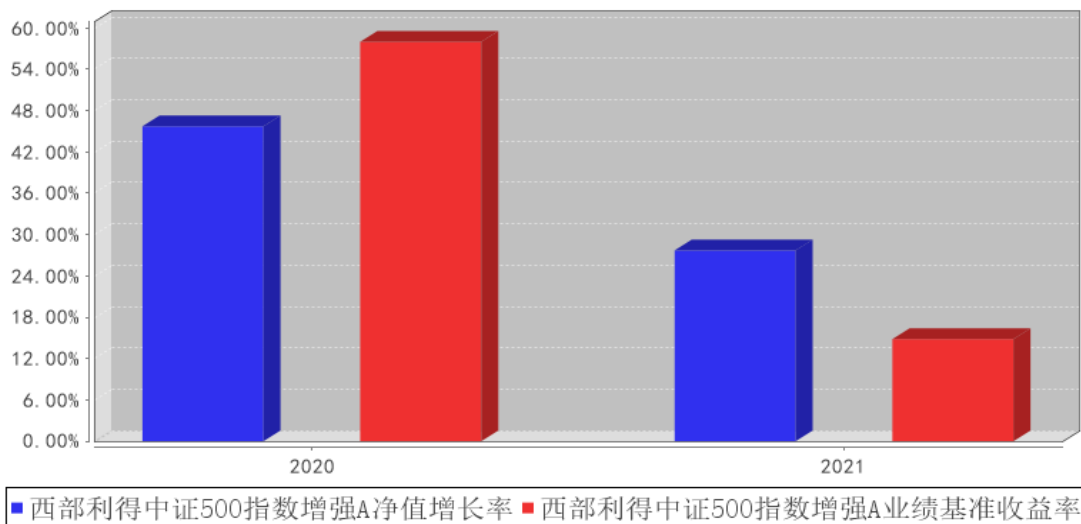


西部利得中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

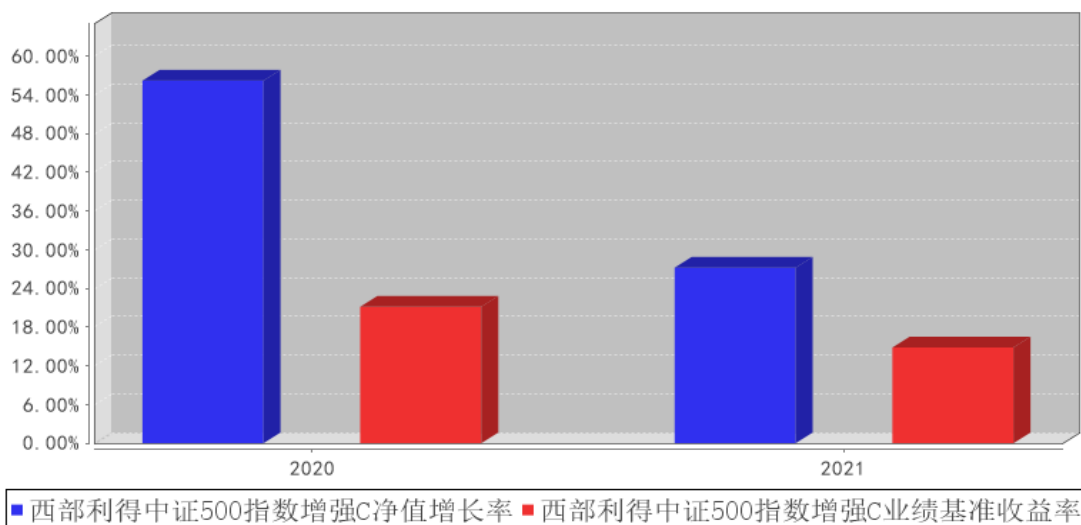


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

西部利得中证500指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



西部利得中证500指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过往三年未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

西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，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 53 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	2020 年 2 月 19 日	-	9 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	2021 年 8 月 18 日	6 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：注：1. 基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、本基金《基金合同》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，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《西部利得基金管理有限公司公平交易管理办法》。针对股票、债券等投资标的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动进行公平交易管理。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《西部利得基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人未发生所有投资组合参与的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% 的情况。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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，持仓特征为中盘、成长，行业配置参考中证 500 指数，相对于基准存在大市值暴露以及高成长因子暴露，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；本基金量化策略的特点是分域建模的基本面量化、专注于能力域、量化为舟主观为舵。本基金努力通过选股获得相对于中证 500 指数的超额收益，以期打造优质的中证 500 指数增强基金，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 2022 年，影响 A 股的主要有三股力量。

其一是国内经济或面临下行压力+流动性宽松

国内经济有下行压力，带动企业盈利增速下行，A 股整体盈利增速预计个位数增长。货币政策易松难紧，两者形成对冲。

其二疫情缓解进度

疫情进入后周期。2021 年冬天新冠疫情在国内小范围再次肆虐，但曙光已不远，市场更为关注前期疫情受损股的恢复程度以及实际的业绩弹性。

其三政策维稳

最新一次政治局会议连提 25 次“稳”；证监会易主席强调突出市场“稳”，保持市场功能正常发挥、稳定市场信心，坚决防止大上天下。后续政策的出台可能会更关注市场波动。2022 年市场走势通道震荡的概率在提高。

预测 2022 年资本市场可能有如下变化：

其一是量化对冲基金被偏债混合基金以及偏债 FOF 接棒其规模。

其二是高端科技创出新赛道。前沿科技、数字基建、业界应用三者之间的碰撞将走出新的模式和增长点。

其三是部分宏观规律失效。当前处于百年未有之大变局关键节点，基于过去几十年总结的部分宏观规律可能失效。汇率、股市、大国利率、通胀、资本跨境流动、风险偏好波动之间的联动关系或出现新的组合。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人始终坚持基金份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。公司监察稽核部依据法律法规的规定及公司内部控制的整体要求，独立对公司经营、旗下投资组合及员工行为等的合规性进行了定期和不定期检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，并定期向监管机构、公司董事会出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核主要工作如下：

- 一、结合公司业务开展的实际情况，进一步完善公司各项内部制度和细化各项业务流程；
- 二、落实内部监察稽核工作，对公司业务流程及管理的各项环节进行定期及不定期稽核；
- 三、根据法律法规及时、准确、完整的披露与本基金有关的各项法定信息披露文件，并在指定报刊和公司网站进行披露，确保基金投资人和公众及时、准确和完整地获取公司和本基金的各项

公开信息；

四、继续加强反洗钱工作力度，进一步落实洗钱风险自评估工作和反洗钱异常报告筛选，并进一步完善工作流程。监察稽核部定期和不定期地向各监管机构按时提交报备各类反洗钱报告，并不断贯彻落实反洗钱法规及监管要求；

五、落实各项合规工作，确保公司各项业务及管理符合法律法规要求；

六、其他各类监察稽核工作。

4.7 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应用性的情况，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。

4.8 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“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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以及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合规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2201170 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“西部利得中证 500 指数增强基金”) 财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了西部利得中证 500 指数增强基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则 (以下简称“审计准则”) 的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于西部利得中证 500 指数增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

	我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>西部利得中证 500 指数增强基金管理人西部利得基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括西部利得中证 500 指数增强基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估西部利得中证 500 指数增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非西部利得中证 500 指数增强基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督西部利得中证 500 指数增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，</p>

	<p>但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对西部利得中证 500 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致西部利得中证 500 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张楠 鲍涵
会计师事务所的地址	上海市静安区南京西路 1266 号 2 幢 25 层
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	472,535,791.63	39,696,102.82
结算备付金		48,466,740.02	12,556,329.42
存出保证金		31,776,209.63	2,475,507.41
交易性金融资产	7.4.7.2	2,520,767,280.54	538,580,616.46
其中：股票投资		2,520,767,280.54	538,580,616.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	10,805,270.38

应收利息	7.4.7.5	46,605.23	6,320.95
应收股利		-	-
应收申购款		6,782,487.15	526,489.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	370.00	370.00
资产总计		3,080,375,484.20	604,647,006.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		59,474,883.91	1,467,023.00
应付赎回款		9,266,427.61	705,031.22
应付管理人报酬		2,544,437.60	455,410.48
应付托管费		508,887.53	91,082.09
应付销售服务费		260,507.27	23,277.36
应付交易费用	7.4.7.7	4,596,332.45	921,944.29
应交税费		190,751.59	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	359,744.25	190,608.60
负债合计		77,201,972.21	3,854,377.04
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,172,833,511.86	573,322,741.52
未分配利润	7.4.7.10	830,340,000.13	27,469,887.93
所有者权益合计		3,003,173,511.99	600,792,629.45
负债和所有者权益总计		3,080,375,484.20	604,647,006.49

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，西部利得中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.8609 元，基金份额总额为 1,206,051,730.27 份；西部利得中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.8486 元，基金份额总额为 410,485,059.19 份。西部利得中证 500 指数增强基金总份额为 1,616,536,789.46 份。

7.2 利润表

会计主体：西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年	2020 年 2 月 19 日 (基金合

		12 月 31 日	同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		347,084,036.11	166,856,186.92
1. 利息收入		941,516.44	184,280.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	941,404.57	184,273.55
债券利息收入		111.87	6.60
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）		297,869,626.10	129,094,530.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	265,436,871.21	123,514,385.39
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	86,452.18	9,897.39
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	21,351,570.88	2,501,865.24
股利收益	7.4.7.16	10,994,731.83	3,068,382.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	47,028,097.57	37,408,839.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,244,796.00	168,537.24
减：二、费用		50,869,599.24	9,881,194.47
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	18,943,312.05	3,570,810.62
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,788,662.45	714,162.15
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,001,206.14	65,837.51
4. 交易费用	7.4.7.19	25,560,611.94	5,117,230.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		87,340.69	10,001.90
7. 其他费用	7.4.7.20	488,465.97	403,151.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		296,214,436.87	156,974,992.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		296,214,436.87	156,974,992.45

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	573,322,741.52	27,469,887.93	600,792,629.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	296,214,436.87	296,214,436.87
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）	1,599,510,770.34	506,655,675.33	2,106,166,445.67
其中：1. 基金申购款	3,045,755,837.14	1,182,440,039.59	4,228,195,876.73
2. 基金赎回款	-1,446,245,066.80	-675,784,364.26	-2,122,029,431.06
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）	2,172,833,511.86	830,340,000.13	3,003,173,511.99
项目	上年度可比期间 2020 年 2 月 19 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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）	522,605,646.22	-162,234,655.92	360,370,990.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	156,974,992.45	156,974,992.45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	50,717,095.30	32,729,551.40	83,446,646.70

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	525,830,352.12	-57,808,291.74	468,022,060.38
2. 基金赎回款	-475,113,256.82	90,537,843.14	-384,575,413.68
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)	573,322,741.52	27,469,887.93	600,792,629.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金转型而来。原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[2014]1414 号《关于准予西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金的批复》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《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式基金,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 202,971,734.99 元,业经普华永道中天会计师事务所普华永道中天验字[2015]第 320 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生效,原基金合同生效日的基金份额总额为 202,990,676.07 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,941.08 份基金份额。

根据原基金的基金管理人西部利得基金管理有限公司于 2020 年 2 月 19 日发布的《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同等法律文件生效的公告》,自 2020 年 2 月 19 日起,原基金更名为西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF),《西部利得中证 500 等权重指数分级证券投资基金基金合同》失效,《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)

基金合同》于同日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。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》和《西部利得中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)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，包括标的指数的成分股、备选成分股、其他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、债券回购、同业存单、银行存款、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相关规定）。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；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。如果法律法规或中国证监会变更基金投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的标的指数为：中证 500 指数
本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+商业银行活期存款利率（税后）*5%

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易为目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险

和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。
- (2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。
- (3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累

计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费【销售服务费】在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊,则于发生时直接计入基金损益;如需采用预提或待摊的方法,预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内,本基金(包括西部利得中证 500 等权重、西部利得中证 500 等权重 A、西部利得中证 500 等权重 B)不进行收益分配。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》、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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	472,535,791.63	39,696,102.82
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	472,535,791.63	39,696,102.82

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,426,211,408.32	2,520,767,280.54	94,555,872.22
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	2,426,211,408.32	2,520,767,280.54	94,555,872.22
项目	上年度末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	488,413,413.07	538,580,616.46	50,167,203.39

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	488,413,413.07	538,580,616.46	50,167,203.39

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	212,298,760.00	-	-	-
其中：股指期货投资	212,298,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	212,298,760.00	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	14,954,840.00	-	-	-
其中：股指期货投资	14,954,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,954,840.00	-	-	-

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：

金额单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2201	IC2201	121.00	178,542,760.00	3,025,120.00
IC2202	IC2202	25	36,753,000.00	-28120.00
总额合计				2997000.00
减：可抵消期货暂收款				-2997000.00
股指期货投资净额				-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	40,655.06	5,500.56
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	5,139.75	550.11
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	1.15	100.00
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	809.27	170.28
合计	46,605.23	6,320.95

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
其他应收款	370.00	370.00
待摊费用	-	-
合计	370.00	370.00

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,596,332.45	921,944.29
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,596,332.45	921,944.29

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	21,040.43	608.60
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	289,891.40	190,000.00
应付指数使用费	48,812.42	-
合计	359,744.25	190,608.60

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

西部利得中证 500 指数增强 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	348,751,038.90	509,617,141.90
本期申购	1,408,703,774.21	2,058,475,844.33
本期赎回 (以“-”号填列)	-551,403,082.84	-805,744,533.56
-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	1,206,051,730.27	1,762,348,452.67

西部利得中证 500 指数增强 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额

上年度末	63,705,599.62	63,705,599.62
本期申购	987,279,992.81	987,279,992.81
本期赎回 (以“-”号填列)	-640,500,533.24	-640,500,533.24
-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	410,485,059.19	410,485,059.19

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

西部利得中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-78,553,740.13	77,145,938.36	-1,407,801.77
本期利润	187,668,823.58	37,494,232.91	225,163,056.49
本期基金份额交易产生的变动数	-27,469,881.30	285,721,643.78	258,251,762.48
其中：基金申购款	-24,509,478.06	469,817,715.38	445,308,237.32
基金赎回款	-2,960,403.24	-184,096,071.60	-187,056,474.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	81,645,202.15	400,361,815.05	482,007,017.20

西部利得中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,082,853.04	12,794,836.66	28,877,689.70
本期利润	61,527,990.68	9,523,389.70	71,051,380.38
本期基金份额交易产生的变动数	143,000,589.48	105,403,323.37	248,403,912.85
其中：基金申购款	437,171,963.99	299,959,838.28	737,131,802.27
基金赎回款	-294,171,374.51	-194,556,514.91	-488,727,889.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	220,611,433.20	127,721,549.73	348,332,982.93

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 2 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	773,442.65	149,377.03
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	125,817.22	22,697.42
其他	42,144.70	12,199.10
合计	941,404.57	184,273.55

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年2月19日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	265,436,871.21	123,514,385.39
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	265,436,871.21	123,514,385.39

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年2月19日(基金合同生效日)至2020年12月31日
卖出股票成交总额	9,913,237,076.83	1,948,410,783.88
减：卖出股票成本总额	9,647,800,205.62	1,824,896,398.49
买卖股票差价收入	265,436,871.21	123,514,385.39

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31 日	上年度可比期间 2020年2月19日（基金合同生效 日）至2020年12月31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	86,452.18	9,897.39
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	86,452.18	9,897.39

7.4.7.13.2 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12月31 日	上年度可比期间 2020年2月19日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成交总额	691,564.52	35,904.40
减：卖出债券（、债转股 及债券到期兑付）成本总 额	605,000.00	26,000.00
减：应收利息总额	112.34	7.01
买卖债券差价收入	86,452.18	9,897.39

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券，资产支持证券投资收益为零。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未持有贵金属。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未有买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	收益金额 2020年2月19日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股指期货投资收益	21,351,570.88	2,501,865.24

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	收益金额 2020年2月19日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	10,994,731.83	3,068,382.36
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	10,994,731.83	3,068,382.36

7.4.7.17 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 12月31日	上年度可比期间 2020年2月19日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日
1. 交易性金融资产	44,388,668.83	37,138,559.15
股票投资	44,388,668.83	37,138,559.15
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	2,726,720.00	270,280.00
权证投资	-	-
期货投资	2,726,720.00	270,280.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	87,291.26	-
合计	47,028,097.57	37,408,839.15

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年2月19日(基金合 同生效日)至2020年12月31 日
基金赎回费收入	1,244,776.93	168,427.16
基金转换费收入	19.07	-
其他	-	110.08
合计	1,244,796.00	168,537.24

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年2月19日(基金合同生效日) 至2020年12月31日
交易所市场交易费用	25,489,917.96	5,117,230.32
银行间市场交易费用	-	-

中金所交易费用	70,693.98	-
合计	25,560,611.94	5,117,230.32

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年2月19日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	80,000.00	73,306.11
信息披露费	120,000.00	103,934.37
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,226.71	867.11
指数使用费	287,239.26	173,076.95
上市费	-	51,967.43
合计	488,465.97	403,151.97

7.4.7.21 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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无

7.4.9 关联方关系

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
兴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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期内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。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期内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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年2月19日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,943,312.05	3,570,810.62
其中：支付销售机构的客户维护费	3,514,151.64	148,021.68

注：支付基金管理人西部利得基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年2月19日（基金合
----	-----------------------------	---------------------------

	月 31 日	同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,788,662.45	714,162.15

注：支付基金托管人兴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 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得中证 500 指数 增强 A	西部利得中证 500 指数 增强 C	合计
西部利得基金	-	539,226.90	539,226.90
西部证券	-	2,446.56	2,446.56
兴业银行	-	0.00	0.00
合计	-	541,673.46	541,673.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 2 月 19 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	西部利得中证 500 指数 增强 A	西部利得中证 500 指数 增强 C	合计
西部利得基金	-	33,600.18	33,600.18
西部证券	-	375.43	375.43
兴业银行	-	0.00	0.00
合计	-	33,975.61	33,975.61

注：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 0.4% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行证券出借业务。

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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年2月19日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	472,535,791.63	773,442.65	39,696,102.82	149,377.03

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人兴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“兴业银行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12月31日的相关余额为人民币10,383,364.97元。（2020年12月31日：人民币1111208.79元）

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 02 月 16 日	锁定期	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	锁定期	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 03 月 16 日	锁定期	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	锁定期	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	锁定期	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	锁定期	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	锁定期	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 01 月 24 日	锁定期	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 01 月 19 日	锁定期	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月	2022 年 1 月	锁定期	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-

		12 日	20 日							
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	锁定期	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	锁定期	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	锁定期	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	锁定期	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	锁定期	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 02 月 16 日	锁定期	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	锁定期	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	锁定期	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	锁定期	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	锁定期	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 02 月 28 日	锁定期	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021 年 8 月	2022 年 2 月	锁定期	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-

		17 日	24 日							
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	锁定期	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	锁定期	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	锁定期	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	锁定期	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	锁定期	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	锁定期	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	锁定期	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	锁定期	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	锁定期	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	锁定期	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	锁定期	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	锁定期	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	锁定期	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	锁定期	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021	2022	锁定期	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-

	王	年 9 月 30 日	年 4 月 14 日							
301081	严牌 股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	锁定期	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛 电气	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 27 日	锁定期	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜 智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	锁定期	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美 股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 28 日	锁定期	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新 药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	锁定期	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润 材料	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 26 日	锁定期	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301091	深城 交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	锁定期	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301092	争光 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	锁定期	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	锁定期	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚 医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	锁定期	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301100	风光 股份	2021 年 12	2022 年 6 月	锁定期	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-

		月 10 日	17 日							
301101	明月镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	锁定期	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	锁定期	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	锁定期	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301126	达嘉维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	锁定期	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301133	金钟股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	锁定期	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	锁定期	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	锁定期	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	锁定期	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	锁定期	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	锁定期	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	锁定期	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-

301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	锁定期	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	锁定期	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	锁定期	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	锁定期	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	锁定期	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	锁定期	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	锁定期	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	锁定期	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	锁定期	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	锁定期	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	锁定期	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688032	禾迈股份	2021年12月13日	2022年6月20日	锁定期	557.80	650.66	1,810	1,009,618.00	1,177,694.60	-

688148	芳源股份	2021年7月30日	2022年2月7日	锁定期	4.58	34.00	11,860	54,318.80	403,240.00	-
688211	中科微至	2021年10月18日	2022年4月26日	锁定期	90.20	71.32	4,501	405,990.20	321,011.32	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2022年1月7日	锁定期	6.42	15.76	2,693	17,289.06	42,441.68	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688285	高铁电气	2021年10月12日	2022年4月20日	锁定期	7.18	9.14	15,159	108,841.62	138,553.26	-
688296	和达科技	2021年7月19日	2022年1月27日	锁定期	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688385	复旦微电	2021年7月27日	2022年2月7日	锁定期	6.23	48.58	8,986	55,982.78	436,539.88	-
688553	汇宇制药	2021年10月14日	2022年4月26日	锁定期	38.87	32.11	8,928	347,031.36	286,678.08	-
688793	倍轻松	2021年7月7日	2022年1月17日	锁定期	27.40	101.73	1,454	39,839.60	147,915.42	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持暂时停牌股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用风险评估、交易对手分类管理、投资比例控制等方式来管控信用风险。

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。本基金的银行存款存放在信用良好的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来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。

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。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人根据法律法规制定了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理办法》，采用事前预警、事中控制和事后评估调整的多重分级控制机制，通过运用制度规范、业务流程控制、实时监控、稽核检查、应急处置等手段对流动性风险进行监督控制。

报告期内本基金严格遵守流动性管理的相关法律法规及管理人内部规定，主要分散投资于流动性较好的股票资产，基金 7 日可变现资产始终保持较高水平，基金资产整体具备良好流动性，基金资产的变现能力可有效应对投资者赎回需求。

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》公布后，本基金未出现接受某一投资者申购申请后导致其份额超过基金总份额 50% 以上的情况。基金管理人对本基金的份额持有人集中度实施严格的监控与管理，根据份额持有人集中度情况对本基金的投资组合实施调整。报告期内本基金主动投资流动性受限资产的市值合计未超过本基金资产净值的 15%。报告期内本基金未出现无法以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项及其他流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	472,535,791.63	-	-	-	472,535,791.63
结算备付金	48,466,740.02	-	-	-	48,466,740.02
存出保证金	31,776,209.63	-	-	-	31,776,209.63
交易性金融资产	-	-	-	2,520,767,280.54	2,520,767,280.54
应收利息	-	-	-	46,605.23	46,605.23
应收申购款	4,616.00	-	-	6,777,871.15	6,782,487.15
其他资产	-	-	-	370.00	370.00
资产总计	552,783,357.28	-	-	-2,527,592,126.92	3,080,375,484.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,266,427.61	9,266,427.61
应付管理人报酬	-	-	-	2,544,437.60	2,544,437.60
应付托管费	-	-	-	508,887.53	508,887.53
应付证券清算款	-	-	-	59,474,883.91	59,474,883.91
应付销售服务费	-	-	-	260,507.27	260,507.27
应付交易费用	-	-	-	4,596,332.45	4,596,332.45
应交税费	-	-	-	190,751.59	190,751.59
其他负债	-	-	-	359,744.25	359,744.25
负债总计	-	-	-	77,201,972.21	77,201,972.21
利率敏感度缺口	552,783,357.28	-	-	-2,450,390,154.71	3,003,173,511.99
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	39,696,102.82	-	-	-	39,696,102.82
结算备付金	12,556,329.42	-	-	-	12,556,329.42
存出保证金	2,475,507.41	-	-	-	2,475,507.41
交易性金融资产	-	-	-	538,580,616.46	538,580,616.46
应收利息	-	-	-	6,320.95	6,320.95
应收申购款	-	-	-	526,489.05	526,489.05
应收证券清算款	-	-	-	10,805,270.38	10,805,270.38
其他资产	-	-	-	370.00	370.00
资产总计	54,727,939.65	-	-	549,919,066.84	604,647,006.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	705,031.22	705,031.22
应付管理人报酬	-	-	-	455,410.48	455,410.48

应付托管费	-	-	-	91,082.09	91,082.09
应付证券清算款	-	-	-	1,467,023.00	1,467,023.00
应付销售服务费	-	-	-	23,277.36	23,277.36
应付交易费用	-	-	-	921,944.29	921,944.29
其他负债	-	-	-	190,608.60	190,608.60
负债总计	-	-	-	3,854,377.04	3,854,377.04
利率敏感度缺口	54,727,939.65	-	-	546,064,689.80	600,792,629.45

注：注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	2,520,767,280.54	83.94	538,580,616.46	89.65
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	2,520,767,280.54	83.94	538,580,616.46	89.65

注：注：本基金投资于标的指数成分股及备选成分股的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于

非现金资产的 80%。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	157,489,568.46	26,219,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-157,489,568.46	-26,219,000.00

7.4.14 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 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为 2,514,581,976.27 元，属于第二层级的余额为 6,185,304.27 元，无属于第三层级的余额（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为 534,586,790.13 元，属于第二层级的余额为 3,993,826.33 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,520,767,280.54	81.83
	其中：股票	2,520,767,280.54	81.83
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	521,002,531.65	16.91
8	其他各项资产	38,605,672.01	1.25
9	合计	3,080,375,484.20	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	123,601,518.30	4.12
C	制造业	1,458,239,513.83	48.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	80,723,495.28	2.69
E	建筑业	14,135,253.50	0.47
F	批发和零售业	16,963,668.82	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	24,933,450.00	0.83
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	202,233,899.36	6.73
J	金融业	170,672,244.10	5.68
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,300,985.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,183,381.70	0.71
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	21,521,568.00	0.72
	合计	2,145,508,977.89	71.44

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	339,742,528.99	11.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	168,328.64	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,845,446.03	0.33
J	金融业	-	-
K	房地产业	25,281,902.20	0.84
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	162,846.86	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	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	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	375,258,302.65	12.50

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金于本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600885	宏发股份	934,300	69,736,152.00	2.32
2	600487	亨通光电	4,576,186	69,191,932.32	2.30
3	600765	中航重机	1,366,600	68,999,634.00	2.30
4	300363	博腾股份	731,100	65,396,895.00	2.18
5	000733	振华科技	512,200	63,656,216.00	2.12
6	002013	中航机电	3,424,122	62,250,537.96	2.07
7	605358	立昂微	508,600	61,037,086.00	2.03
8	600195	中牧股份	4,566,536	59,684,625.52	1.99
9	000960	锡业股份	2,987,300	58,341,969.00	1.94
10	600875	东方电气	2,625,700	56,242,494.00	1.87
11	601615	明阳智能	2,130,700	55,611,270.00	1.85
12	603707	健友股份	1,301,491	54,662,622.00	1.82
13	000519	中兵红箭	2,040,629	54,423,575.43	1.81
14	002180	纳思达	1,132,380	54,082,468.80	1.80
15	600348	华阳股份	4,548,058	53,894,487.30	1.79
16	688536	思瑞浦	69,200	53,145,600.00	1.77
17	603290	斯达半导	136,100	51,854,100.00	1.73
18	603589	口子窖	727,300	51,543,751.00	1.72
19	603198	迎驾贡酒	707,215	49,116,081.75	1.64
20	600863	内蒙华电	12,276,300	48,368,622.00	1.61
21	002128	电投能源	3,148,300	46,752,255.00	1.56
22	300166	东方国信	4,316,600	46,619,280.00	1.55
23	002028	思源电气	898,500	44,215,185.00	1.47
24	002926	华西证券	4,190,000	41,271,500.00	1.37
25	601128	常熟银行	5,975,500	39,498,055.00	1.32
26	002797	第一创业	5,137,200	37,604,304.00	1.25
27	600507	方大特钢	4,499,112	35,093,073.60	1.17
28	600803	新奥股份	1,762,248	32,354,873.28	1.08

29	000728	国元证券	4,199,915	32,339,345.50	1.08
30	002268	卫士通	575,500	32,193,470.00	1.07
31	002080	中材科技	944,312	32,125,494.24	1.07
32	002507	涪陵榨菜	844,700	31,929,660.00	1.06
33	600141	兴发集团	833,800	31,584,344.00	1.05
34	600516	方大炭素	2,819,732	30,509,500.24	1.02
35	600486	扬农化工	205,872	27,010,406.40	0.90
36	002603	以岭药业	1,300,900	25,497,640.00	0.85
37	600329	中新药业	799,832	25,122,723.12	0.84
38	001872	招商港口	1,471,000	24,933,450.00	0.83
39	002408	齐翔腾达	2,348,252	24,656,646.00	0.82
40	002439	启明星辰	851,912	24,305,049.36	0.81
41	300212	易华录	660,000	23,331,000.00	0.78
42	601699	潞安环能	2,029,600	22,954,776.00	0.76
43	300037	新宙邦	202,600	22,893,800.00	0.76
44	603613	国联股份	210,600	22,639,500.00	0.75
45	000959	首钢股份	3,881,600	22,241,568.00	0.74
46	002831	裕同科技	639,796	21,554,727.24	0.72
47	600673	东阳光	2,423,600	21,521,568.00	0.72
48	603568	伟明环保	579,890	21,183,381.70	0.71
49	603267	鸿远电子	106,057	19,030,868.08	0.63
50	002505	鹏都农牧	4,440,751	16,963,668.82	0.56
51	603866	桃李面包	558,620	15,864,808.00	0.53
52	000090	天健集团	2,408,050	14,135,253.50	0.47
53	600298	安琪酵母	196,200	11,842,632.00	0.39
54	600782	新钢股份	2,235,300	11,802,384.00	0.39
55	600415	小商品城	2,330,100	11,300,985.00	0.38
56	002925	盈趣科技	248,765	8,465,472.95	0.28
57	601187	厦门银行	1,159,984	8,003,889.60	0.27
58	600808	马钢股份	1,968,122	7,262,370.18	0.24
59	600908	无锡银行	1,062,200	6,022,674.00	0.20
60	601577	长沙银行	759,600	5,932,476.00	0.20
61	300763	锦浪科技	16,000	3,704,800.00	0.12

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600383	金地集团	1,949,260	25,281,902.20	0.84
2	002648	卫星化学	586,467	23,476,274.01	0.78
3	002709	天赐材料	193,116	22,140,749.40	0.74
4	300260	新莱应材	377,200	17,792,524.00	0.59

5	300358	楚天科技	642,000	16,736,940.00	0.56
6	300171	东富龙	298,900	15,106,406.00	0.50
7	002008	大族激光	276,100	14,909,400.00	0.50
8	002472	双环传动	526,000	14,507,080.00	0.48
9	600585	海螺水泥	340,300	13,714,090.00	0.46
10	300672	国科微	70,100	13,003,550.00	0.43
11	000933	神火股份	1,422,000	12,925,980.00	0.43
12	603659	璞泰来	78,400	12,591,824.00	0.42
13	688033	天宜上佳	367,400	12,142,570.00	0.40
14	600779	水井坊	94,800	11,375,052.00	0.38
15	603260	合盛硅业	84,673	11,174,295.81	0.37
16	300820	英杰电气	122,800	11,039,720.00	0.37
17	002326	永太科技	214,000	10,958,940.00	0.36
18	000657	中钨高新	676,700	10,881,336.00	0.36
19	688357	建龙微纳	56,300	10,806,222.00	0.36
20	600869	远东股份	1,567,600	10,785,088.00	0.36
21	300573	兴齐眼药	76,000	10,396,800.00	0.35
22	688388	嘉元科技	81,000	10,169,550.00	0.34
23	600887	伊利股份	217,000	8,996,820.00	0.30
24	600089	特变电工	391,236	8,282,466.12	0.28
25	688518	联赢激光	124,650	6,141,505.50	0.20
26	600882	妙可蓝多	90,900	5,090,400.00	0.17
27	688017	绿的谐波	27,765	4,846,658.40	0.16
28	600378	昊华科技	98,600	4,752,520.00	0.16
29	688356	键凯科技	14,000	4,719,820.00	0.16
30	688023	安恒信息	17,475	4,381,681.50	0.15
31	688301	奕瑞科技	8,800	4,372,720.00	0.15
32	300496	中科创达	24,000	3,322,080.00	0.11
33	300673	佩蒂股份	100,000	2,048,000.00	0.07
34	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.06
35	688032	禾迈股份	1,810	1,177,694.60	0.04
36	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.01
37	688148	芳源股份	11,860	403,240.00	0.01
38	688211	中科微至	4,501	321,011.32	0.01
39	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
40	688553	汇宇制药	8,928	286,678.08	0.01
41	688601	力芯微	1,174	178,213.20	0.01
42	688793	倍轻松	1,454	147,915.42	0.00
43	688285	高铁电气	15,159	138,553.26	0.00
44	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.00
45	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
46	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
47	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00

48	688226	威腾电气	2,693	42,441.68	0.00
49	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
50	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
51	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
52	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
53	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
54	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
55	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
56	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
57	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
58	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
59	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
60	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
61	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
62	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
63	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
64	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
65	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
66	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
67	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
68	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
69	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
70	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
71	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
72	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
73	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
74	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
75	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
76	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
77	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
78	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
79	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
80	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
81	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
82	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
83	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
84	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
85	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
86	300986	志特新材	164	10,497.64	0.00
87	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
88	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
89	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
90	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00

91	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
92	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
93	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
94	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
95	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
96	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
97	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
98	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
99	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
100	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
101	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
102	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
103	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
104	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
105	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
106	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
107	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
108	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
109	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
110	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
111	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
112	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
113	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
114	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
115	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
116	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
117	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
118	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
119	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
120	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
121	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002648	卫星化学	172,284,482.44	28.68
2	600885	宏发股份	164,540,786.44	27.39
3	601699	潞安环能	164,416,511.25	27.37
4	002709	天赐材料	154,583,910.68	25.73
5	600141	兴发集团	138,093,162.39	22.99
6	605358	立昂微	136,801,641.46	22.77
7	601636	旗滨集团	130,665,022.98	21.75

8	600487	亨通光电	129,175,244.60	21.50
9	603260	合盛硅业	126,799,793.22	21.11
10	002185	华天科技	124,665,209.53	20.75
11	300037	新宙邦	124,299,039.09	20.69
12	600188	兖矿能源	123,416,808.00	20.54
13	600884	杉杉股份	122,357,351.08	20.37
14	300285	国瓷材料	117,555,450.74	19.57
15	002156	通富微电	116,309,517.28	19.36
16	000988	华工科技	110,819,376.48	18.45
17	600549	厦门钨业	106,002,086.89	17.64
18	000799	酒鬼酒	104,274,350.21	17.36
19	600089	特变电工	104,006,218.13	17.31
20	002797	第一创业	97,533,652.67	16.23
21	600219	南山铝业	97,198,053.55	16.18
22	002028	思源电气	96,487,906.49	16.06
23	603290	斯达半导	95,809,995.00	15.95
24	600779	水井坊	92,679,694.62	15.43
25	300316	晶盛机电	91,474,889.15	15.23
26	603486	科沃斯	90,734,015.17	15.10
27	688099	晶晨股份	89,670,130.64	14.93
28	002013	中航机电	87,236,471.32	14.52
29	000807	云铝股份	87,142,817.58	14.50
30	600563	法拉电子	86,735,513.24	14.44
31	002223	鱼跃医疗	84,510,956.69	14.07
32	600755	厦门国贸	84,346,922.28	14.04
33	603444	吉比特	83,588,450.40	13.91
34	603225	新凤鸣	82,920,604.95	13.80
35	300207	欣旺达	82,357,849.00	13.71
36	688208	道通科技	79,013,255.44	13.15
37	603198	迎驾贡酒	74,835,767.42	12.46
38	600765	中航重机	74,215,034.16	12.35
39	600956	新天绿能	73,433,659.84	12.22
40	601233	桐昆股份	72,373,342.49	12.05
41	300363	博腾股份	70,598,538.72	11.75
42	601168	西部矿业	69,499,567.74	11.57
43	000733	振华科技	68,948,740.08	11.48
44	600171	上海贝岭	68,407,654.11	11.39
45	002048	宁波华翔	67,519,986.05	11.24
46	300296	利亚德	66,690,828.98	11.10
47	601615	明阳智能	66,268,771.94	11.03
48	000960	锡业股份	65,691,809.78	10.93
49	002080	中材科技	65,277,897.56	10.87

50	000825	太钢不锈	65,236,388.50	10.86
51	002268	卫士通	65,098,226.36	10.84
52	601598	中国外运	64,487,858.13	10.73
53	002131	利欧股份	64,145,310.00	10.68
54	000830	鲁西化工	63,348,043.00	10.54
55	300223	北京君正	63,101,095.99	10.50
56	002002	鸿达兴业	62,502,942.86	10.40
57	600875	东方电气	60,523,863.55	10.07
58	000012	南玻A	60,377,736.00	10.05
59	688536	思瑞浦	59,257,008.71	9.86
60	002266	浙富控股	58,620,169.50	9.76
61	603589	口子窖	58,604,229.96	9.75
62	002867	周大生	58,321,227.08	9.71
63	000050	深天马A	57,120,717.00	9.51
64	600808	马钢股份	56,327,919.15	9.38
65	000999	华润三九	55,840,278.75	9.29
66	000629	攀钢钒钛	55,824,710.16	9.29
67	603707	健友股份	55,620,142.04	9.26
68	002128	电投能源	55,548,269.87	9.25
69	600348	华阳股份	55,169,597.38	9.18
70	000519	中兵红箭	54,280,992.09	9.03
71	002925	盈趣科技	53,693,900.37	8.94
72	002180	纳思达	53,238,122.54	8.86
73	002532	天山铝业	52,332,646.60	8.71
74	600195	中牧股份	51,961,780.76	8.65
75	002396	星网锐捷	51,662,975.00	8.60
76	002690	美亚光电	51,590,792.59	8.59
77	600546	山煤国际	51,436,975.99	8.56
78	600008	首创环保	51,061,056.60	8.50
79	002831	裕同科技	50,738,004.01	8.45
80	300146	汤臣倍健	48,190,556.00	8.02
81	603883	老百姓	48,081,279.21	8.00
82	600863	内蒙华电	47,656,906.31	7.93
83	002444	巨星科技	47,290,913.87	7.87
84	002505	鹏都农牧	47,269,426.26	7.87
85	300166	东方国信	45,976,281.21	7.65
86	600507	方大特钢	45,967,716.69	7.65
87	002926	华西证券	45,311,550.40	7.54
88	688002	睿创微纳	45,234,176.68	7.53
89	600803	新奥股份	44,062,153.31	7.33
90	000887	中鼎股份	43,784,024.92	7.29
91	003022	联泓新科	43,174,943.68	7.19

92	002353	杰瑞股份	42,380,541.35	7.05
93	600497	驰宏锌锗	42,337,961.51	7.05
94	000009	中国宝安	41,941,677.63	6.98
95	600426	华鲁恒升	41,615,693.83	6.93
96	600782	新钢股份	40,997,351.53	6.82
97	002326	永太科技	40,916,477.00	6.81
98	603893	瑞芯微	40,874,172.00	6.80
99	601128	常熟银行	39,942,389.00	6.65
100	000898	鞍钢股份	39,865,761.20	6.64
101	300618	寒锐钴业	39,204,923.93	6.53
102	600160	巨化股份	38,421,705.27	6.40
103	300595	欧普康视	38,307,517.22	6.38
104	600862	中航高科	37,505,500.98	6.24
105	300012	华测检测	37,156,091.73	6.18
106	002429	兆驰股份	37,001,932.34	6.16
107	603816	顾家家居	36,743,081.74	6.12
108	002439	启明星辰	36,428,719.12	6.06
109	000723	美锦能源	36,395,309.00	6.06
110	002603	以岭药业	36,367,258.00	6.05
111	002092	中泰化学	35,234,356.00	5.86
112	002507	涪陵榨菜	34,881,888.17	5.81
113	603267	鸿远电子	34,659,425.51	5.77
114	688029	南微医学	34,461,416.79	5.74
115	002511	中顺洁柔	34,334,379.08	5.71
116	600329	中新药业	33,593,585.20	5.59
117	001914	招商积余	32,402,412.00	5.39
118	000728	国元证券	31,952,202.30	5.32
119	600486	扬农化工	31,669,484.48	5.27
120	603638	艾迪精密	31,660,582.07	5.27
121	600516	方大炭素	31,339,275.22	5.22
122	000937	冀中能源	31,073,650.34	5.17
123	001872	招商港口	31,003,562.28	5.16
124	600258	首旅酒店	29,805,511.30	4.96
125	300009	安科生物	29,621,576.66	4.93
126	601966	玲珑轮胎	29,539,963.07	4.92
127	603379	三美股份	29,500,918.02	4.91
128	601577	长沙银行	29,253,382.77	4.87
129	002985	北摩高科	29,133,307.60	4.85
130	600754	锦江酒店	29,027,706.62	4.83
131	600039	四川路桥	28,542,497.00	4.75
132	600456	宝钛股份	28,176,548.74	4.69
133	600256	广汇能源	28,121,340.00	4.68

134	600409	三友化工	27,993,708.90	4.66
135	300463	迈克生物	27,566,939.49	4.59
136	600673	东阳光	27,195,277.30	4.53
137	300482	万孚生物	27,159,000.84	4.52
138	002064	华峰化学	27,158,472.75	4.52
139	000959	首钢股份	27,065,656.00	4.50
140	002078	太阳纸业	27,061,762.00	4.50
141	002408	齐翔腾达	27,002,091.16	4.49
142	300496	中科创达	26,775,736.87	4.46
143	002138	顺络电子	26,243,100.00	4.37
144	600026	中远海能	26,231,039.17	4.37
145	601778	晶科科技	26,188,790.00	4.36
146	603613	国联股份	25,446,965.05	4.24
147	002110	三钢闽光	25,257,364.00	4.20
148	300474	景嘉微	24,831,324.00	4.13
149	600383	金地集团	24,759,553.17	4.12
150	600529	山东药玻	24,212,949.22	4.03
151	300115	长盈精密	24,032,111.96	4.00
152	300212	易华录	23,916,888.00	3.98
153	600801	华新水泥	22,512,188.10	3.75
154	000739	普洛药业	22,330,091.77	3.72
155	002390	信邦制药	22,133,849.04	3.68
156	002791	坚朗五金	22,099,030.10	3.68
157	601005	重庆钢铁	21,857,096.00	3.64
158	600282	南钢股份	21,775,058.00	3.62
159	603737	三棵树	21,670,492.00	3.61
160	603568	伟明环保	21,619,909.80	3.60
161	000581	威孚高科	21,416,750.15	3.56
162	600132	重庆啤酒	20,562,570.15	3.42
163	600460	士兰微	20,545,682.61	3.42
164	600958	东方证券	20,054,332.00	3.34
165	600201	生物股份	19,076,970.79	3.18
166	300841	康华生物	18,161,886.13	3.02
167	601799	星宇股份	17,978,768.91	2.99
168	601003	柳钢股份	17,629,235.75	2.93
169	600867	通化东宝	17,459,731.30	2.91
170	603866	桃李面包	16,994,945.08	2.83
171	002563	森马服饰	16,778,564.10	2.79
172	300327	中颖电子	16,557,362.00	2.76
173	002221	东华能源	16,514,771.00	2.75
174	601689	拓普集团	16,494,002.69	2.75
175	002368	太极股份	16,374,617.60	2.73

176	600985	淮北矿业	16,182,418.47	2.69
177	600048	保利发展	16,069,722.00	2.67
178	002920	德赛西威	16,065,798.00	2.67
179	002010	传化智联	15,951,718.00	2.66
180	300171	东富龙	15,667,179.00	2.61
181	603882	金域医学	15,665,523.00	2.61
182	000002	万科A	15,614,105.57	2.60
183	002472	双环传动	15,429,403.87	2.57
184	603345	安井食品	15,347,613.00	2.55
185	603659	璞泰来	15,164,289.45	2.52
186	002206	海利得	14,973,848.46	2.49
187	600060	海信视像	14,958,088.00	2.49
188	000933	神火股份	14,648,190.80	2.44
189	000998	隆平高科	14,628,397.00	2.43
190	300058	蓝色光标	14,569,457.09	2.43
191	000090	天健集团	14,115,143.00	2.35
192	002375	亚厦股份	13,919,198.00	2.32
193	000301	东方盛虹	13,911,516.00	2.32
194	002624	完美世界	13,797,667.32	2.30
195	000983	山西焦煤	13,657,552.10	2.27
196	300260	新莱应材	13,641,788.52	2.27
197	300573	兴齐眼药	13,385,818.00	2.23
198	600350	山东高速	13,326,121.00	2.22
199	600276	恒瑞医药	13,312,539.76	2.22
200	000538	云南白药	13,290,527.24	2.21
201	002475	立讯精密	13,148,911.24	2.19
202	000776	广发证券	13,096,739.00	2.18
203	002352	顺丰控股	13,085,062.00	2.18
204	000651	格力电器	13,079,427.38	2.18
205	601717	郑煤机	13,057,486.00	2.17
206	600585	海螺水泥	12,956,807.00	2.16
207	600667	太极实业	12,805,527.94	2.13
208	603885	吉祥航空	12,785,580.00	2.13
209	688050	爱博医疗	12,759,043.51	2.12
210	600170	上海建工	12,751,576.21	2.12
211	688388	嘉元科技	12,679,488.63	2.11
212	600038	中直股份	12,671,931.00	2.11
213	002008	大族激光	12,656,201.00	2.11
214	688518	联赢激光	12,538,915.48	2.09
215	300630	普利制药	12,526,037.54	2.08
216	300358	楚天科技	12,510,462.00	2.08
217	300672	国科微	12,505,455.00	2.08

218	000657	中钨高新	12,427,597.00	2.07
219	002839	张家港行	12,380,074.00	2.06
220	002727	一心堂	12,343,718.47	2.05
221	300593	新雷能	12,303,423.00	2.05
222	002074	国轩高科	12,267,441.00	2.04
223	000425	徐工机械	12,251,897.00	2.04
224	300820	英杰电气	12,228,643.00	2.04
225	688066	航天宏图	12,213,541.36	2.03
226	600869	远东股份	12,155,819.00	2.02
227	600702	舍得酒业	12,028,804.00	2.00

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002709	天赐材料	168,490,803.19	28.04
2	603260	合盛硅业	168,070,928.86	27.97
3	002648	卫星化学	163,774,101.03	27.26
4	600089	特变电工	143,632,218.78	23.91
5	600884	杉杉股份	136,452,450.16	22.71
6	600188	兖矿能源	122,675,136.31	20.42
7	002185	华天科技	120,682,481.60	20.09
8	601699	潞安环能	119,894,569.32	19.96
9	300285	国瓷材料	118,165,895.84	19.67
10	601636	旗滨集团	115,858,234.96	19.28
11	000799	酒鬼酒	114,214,481.80	19.01
12	600549	厦门钨业	114,081,436.42	18.99
13	600563	法拉电子	110,340,755.43	18.37
14	002156	通富微电	109,506,732.84	18.23
15	000988	华工科技	108,924,811.70	18.13
16	600885	宏发股份	108,539,943.83	18.07
17	600219	南山铝业	108,524,826.52	18.06
18	603486	科沃斯	107,014,700.54	17.81
19	600141	兴发集团	106,947,477.48	17.80
20	300316	晶盛机电	101,377,503.11	16.87
21	000807	云铝股份	95,757,146.58	15.94
22	688099	晶晨股份	95,527,986.09	15.90
23	300037	新宙邦	90,194,826.00	15.01
24	002223	鱼跃医疗	86,864,757.96	14.46
25	600779	水井坊	83,120,575.98	13.84

26	688208	道通科技	80,159,565.99	13.34
27	600755	厦门国贸	79,920,094.76	13.30
28	300223	北京君正	79,017,432.32	13.15
29	603444	吉比特	78,124,033.12	13.00
30	600956	新天绿能	77,203,635.84	12.85
31	601168	西部矿业	74,423,432.99	12.39
32	000830	鲁西化工	72,257,640.04	12.03
33	601233	桐昆股份	70,060,496.00	11.66
34	300207	欣旺达	69,328,039.53	11.54
35	002048	宁波华翔	69,131,171.02	11.51
36	603225	新凤鸣	68,726,303.98	11.44
37	002266	浙富控股	66,498,044.54	11.07
38	000825	太钢不锈	65,918,243.00	10.97
39	002867	周大生	65,770,617.71	10.95
40	300296	利亚德	63,690,853.84	10.60
41	000009	中国宝安	63,635,925.75	10.59
42	600487	亨通光电	63,099,509.06	10.50
43	002797	第一创业	60,917,861.94	10.14
44	605358	立昂微	59,847,517.71	9.96
45	600171	上海贝岭	59,129,214.83	9.84
46	688002	睿创微纳	57,758,146.95	9.61
47	002002	鸿达兴业	57,439,706.58	9.56
48	603290	斯达半导	57,095,882.00	9.50
49	601598	中国外运	56,733,651.10	9.44
50	600008	首创环保	56,564,385.00	9.41
51	002444	巨星科技	56,504,091.35	9.40
52	603198	迎驾贡酒	56,000,041.19	9.32
53	002131	利欧股份	55,428,813.07	9.23
54	000012	南玻A	54,039,452.52	8.99
55	002028	思源电气	53,976,146.57	8.98
56	300146	汤臣倍健	53,881,605.15	8.97
57	003022	联泓新科	52,738,753.43	8.78
58	000887	中鼎股份	52,193,139.05	8.69
59	000050	深天马A	51,212,905.03	8.52
60	600497	驰宏锌锗	49,772,535.17	8.28
61	000999	华润三九	49,341,400.80	8.21
62	002080	中材科技	48,562,475.57	8.08
63	000629	攀钢钒钛	47,739,289.35	7.95
64	002396	星网锐捷	47,083,782.61	7.84
65	002013	中航机电	46,814,317.70	7.79
66	000898	鞍钢股份	46,717,135.12	7.78
67	000723	美锦能源	46,177,719.62	7.69

68	600808	马钢股份	45,598,949.00	7.59
69	600546	山煤国际	45,404,524.99	7.56
70	002268	卫士通	44,016,046.40	7.33
71	002690	美亚光电	43,416,151.75	7.23
72	002925	盈趣科技	42,918,889.94	7.14
73	603883	老百姓	42,790,401.79	7.12
74	002505	鹏都农牧	41,523,890.50	6.91
75	002532	天山铝业	41,425,010.50	6.90
76	600426	华鲁恒升	41,331,640.94	6.88
77	300595	欧普康视	41,149,840.43	6.85
78	001914	招商积余	40,937,635.27	6.81
79	601966	玲珑轮胎	39,420,005.96	6.56
80	300482	万孚生物	39,407,981.83	6.56
81	300618	寒锐钴业	38,997,150.27	6.49
82	300012	华测检测	38,752,026.16	6.45
83	688029	南微医学	38,717,596.72	6.44
84	002353	杰瑞股份	38,301,896.52	6.38
85	603893	瑞芯微	37,959,696.60	6.32
86	600160	巨化股份	37,405,467.01	6.23
87	600862	中航高科	37,392,540.00	6.22
88	600765	中航重机	36,591,636.53	6.09
89	603816	顾家家居	36,525,343.36	6.08
90	002064	华峰化学	36,208,034.70	6.03
91	600409	三友化工	35,783,800.00	5.96
92	002429	兆驰股份	35,611,700.82	5.93
93	002791	坚朗五金	34,627,262.00	5.76
94	002092	中泰化学	33,045,951.00	5.50
95	002511	中顺洁柔	32,593,529.02	5.43
96	600256	广汇能源	31,345,618.73	5.22
97	300496	中科创达	31,018,399.03	5.16
98	603638	艾迪精密	30,723,452.08	5.11
99	600039	四川路桥	30,541,714.00	5.08
100	000937	冀中能源	29,976,212.40	4.99
101	300115	长盈精密	29,930,538.98	4.98
102	000739	普洛药业	29,644,770.64	4.93
103	600258	首旅酒店	29,560,287.73	4.92
104	600456	宝钛股份	29,269,136.71	4.87
105	000519	中兵红箭	29,251,197.00	4.87
106	300009	安科生物	29,189,266.02	4.86
107	601799	星宇股份	28,923,083.00	4.81
108	002138	顺络电子	28,338,035.00	4.72
109	002985	北摩高科	28,172,853.40	4.69

110	600026	中远海能	28,159,191.54	4.69
111	601005	重庆钢铁	28,153,268.00	4.69
112	002831	裕同科技	27,813,970.73	4.63
113	600754	锦江酒店	26,431,806.00	4.40
114	002110	三钢闽光	26,158,795.00	4.35
115	600782	新钢股份	24,619,547.00	4.10
116	300463	迈克生物	24,598,222.00	4.09
117	002326	永太科技	24,475,742.10	4.07
118	002078	太阳纸业	24,233,929.40	4.03
119	600529	山东药玻	23,988,166.00	3.99
120	600460	士兰微	23,631,651.11	3.93
121	603379	三美股份	23,307,526.50	3.88
122	002390	信邦制药	22,956,335.77	3.82
123	600132	重庆啤酒	22,898,667.29	3.81
124	601778	晶科科技	22,644,049.00	3.77
125	600875	东方电气	22,546,663.00	3.75
126	601577	长沙银行	22,315,745.68	3.71
127	300474	景嘉微	21,647,554.89	3.60
128	000581	威孚高科	21,172,359.91	3.52
129	600282	南钢股份	21,130,994.00	3.52
130	600958	东方证券	20,513,576.00	3.41
131	600801	华新水泥	19,768,302.00	3.29
132	600867	通化东宝	19,700,690.80	3.28
133	600079	人福医药	19,240,945.46	3.20
134	002368	太极股份	19,222,053.46	3.20
135	601689	拓普集团	18,780,141.79	3.13
136	002920	德赛西威	18,288,637.00	3.04
137	002221	东华能源	18,280,959.00	3.04
138	002839	张家港行	18,206,894.73	3.03
139	601003	柳钢股份	18,098,712.61	3.01
140	300841	康华生物	17,925,248.50	2.98
141	600201	生物股份	17,795,725.06	2.96
142	002557	洽洽食品	17,583,702.58	2.93
143	600048	保利发展	17,511,371.00	2.91
144	300327	中颖电子	16,988,299.60	2.83
145	000960	锡业股份	16,847,813.00	2.80
146	002572	索菲亚	16,669,045.00	2.77
147	603267	鸿远电子	16,598,139.93	2.76
148	002568	百润股份	16,336,002.00	2.72
149	600486	扬农化工	16,288,538.26	2.71
150	600507	方大特钢	16,196,300.79	2.70
151	002010	传化智联	16,014,973.00	2.67

152	603882	金域医学	15,810,932.00	2.63
153	000002	万科A	15,597,430.59	2.60
154	300274	阳光电源	15,533,185.00	2.59
155	002563	森马服饰	15,486,436.60	2.58
156	603737	三棵树	15,263,767.40	2.54
157	603345	安井食品	15,227,061.00	2.53
158	002439	启明星辰	15,170,055.00	2.53
159	002705	新宝股份	15,104,565.04	2.51
160	002624	完美世界	15,101,621.00	2.51
161	002375	亚厦股份	15,030,926.00	2.50
162	002475	立讯精密	14,747,144.20	2.45
163	600985	淮北矿业	14,653,205.00	2.44
164	300630	普利制药	14,629,792.87	2.44
165	000776	广发证券	14,270,424.00	2.38
166	600276	恒瑞医药	14,222,283.45	2.37
167	000733	振华科技	14,079,452.48	2.34
168	002922	伊戈尔	13,980,084.00	2.33
169	300409	道氏技术	13,959,005.00	2.32
170	600060	海信视像	13,800,569.50	2.30
171	000301	东方盛虹	13,614,170.50	2.27
172	000651	格力电器	13,593,869.24	2.26
173	300058	蓝色光标	13,441,634.00	2.24
174	603806	福斯特	13,366,124.32	2.22
175	000538	云南白药	13,082,208.16	2.18
176	002372	伟星新材	12,974,749.96	2.16
177	002352	顺丰控股	12,860,541.00	2.14
178	688200	华峰测控	12,686,086.12	2.11
179	000998	隆平高科	12,665,176.00	2.11
180	002056	横店东磁	12,566,253.74	2.09
181	600350	山东高速	12,364,992.00	2.06
182	002074	国轩高科	12,362,042.00	2.06
183	300911	亿田智能	12,159,225.29	2.02
184	600667	太极实业	12,113,310.00	2.02
185	300593	新雷能	12,086,949.86	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	11,585,598,200.87
卖出股票收入（成交）总额	9,913,237,076.83

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金于本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金于本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金于本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金于本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金于本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2201	IC2201	121	178,542,760.00	3,025,120.00	-
IC2202	IC2202	25	36,753,000.00	-28,120.00	-
公允价值变动总额合计（元）					2,997,000.00
股指期货投资本期收益（元）					21,351,570.88
股指期货投资本期公允价值变动（元）					2,726,720.00

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金于本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金于本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	31,776,209.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	46,605.23
5	应收申购款	6,782,487.15
6	其他应收款	370.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,605,672.01

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (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 (%)
西部利得中证 500 指数增强 A	141,534	8,521.29	647,882,519.74	53.72	558,169,210.53	46.28
西部利得中证 500 指数增强 C	57,499	7,138.99	229,367,667.15	55.88	181,117,392.04	44.12
合计	193,649	8,347.77	877,250,186.89	54.27	739,286,602.57	45.73

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）。

9.2 期末上市基金前十名持有人

西部利得中证 500 指数增强 A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	上海康衢企业发展有限公司	4,722,421.00	3.72
2	刘海桥	2,154,833.00	1.70

3	湖南省财信信托有限责任公司-财信优选创赢 5 号集合资金信托计划	1,686,255.00	1.33
4	刘霞	1,597,738.00	1.26
5	闫巧妞	1,589,100.00	1.25
6	郭巨康	1,280,138.00	1.01
7	伍丽莲	1,135,640.00	0.89
8	薛占龙	1,068,600.00	0.84
9	上海珠池资产管理有 限公司-珠池御风私募 证券投资基金 1 期	1,025,491.00	0.81
10	林洁丽	1,023,928.00	0.81

9.3 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	西部利得中证 500 指数增强 A	235,509.39	0.0195
	西部利得中证 500 指数增强 C	29,404.91	0.0072
	合计	264,914.30	0.0267

9.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	西部利得中证 500 指数增强 A	0~10
	西部利得中证 500 指数增强 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	西部利得中证 500 指数增强 A	-
	西部利得中证 500 指数增强 C	-
	合计	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	西部利得中证 500 指数增强 A	西部利得中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2020 年 2 月 19 日) 基金份额总额	357,635,043.89	-

本报告期期初基金份额总额	348,751,038.90	63,705,599.62
本报告期基金总申购份额	1,408,703,774.21	987,279,992.81
减：本报告期基金总赎回份额	551,403,082.84	640,500,533.24
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	1,206,051,730.27	410,485,059.19

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人高级管理人员变动如下：

1. 基金管理人于 2021 年 1 月完成董事曲莉、独立董事吴弘和张成虎的任职备案；
2. 基金管理人于 2021 年 1 月完成副总经理孙威、王宇和蔡晨研的任职备案；
3. 基金管理人于 2021 年 8 月完成独立董事吴海独立董事的任职备案。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 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。本报告期应支付毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费人民币 80,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	5,263,435,841.70	24.52%	4,239,295.66	31.26%	-
华西证券	2	2,841,034,793.72	13.24%	1,513,017.06	11.16%	-
银河证券	2	2,503,083,464.85	11.66%	403,736.08	2.98%	-
广发证券	1	2,104,165,706.24	9.80%	1,538,793.96	11.35%	-
东吴证券	2	2,048,859,994.72	9.55%	1,088,566.04	8.03%	-
华金证券	3	1,906,562,536.76	8.88%	1,394,276.98	10.28%	-
招商证券	2	1,668,960,700.49	7.78%	1,220,509.54	9.00%	-
东兴证券	2	959,546,989.12	4.47%	701,724.32	5.17%	-
光大证券股份有限公司	2	854,570,769.31	3.98%	676,230.95	4.99%	-
东北证券	2	621,077,066.99	2.89%	267,873.34	1.97%	-
太平洋证券	2	277,428,370.70	1.29%	175,141.91	1.29%	-
财信证券	1	179,895,215.52	0.84%	131,557.97	0.97%	-
申万宏源	2	172,225,046.68	0.80%	160,394.21	1.18%	-
中泰证券	2	63,006,470.68	0.29%	52,377.15	0.39%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 基金租用席位的选择标准是：（1）实力雄厚，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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
中信建投	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	558,796.70	80.80%	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券	106,517.57	15.40%	-	-	-	-
太平洋证券	26,250.25	3.80%	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	西部利得基金管理有限公司关于公司董事及独立董事变更公告	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 7 日
2	西部利得基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	同上	2021 年 1 月 11 日
3	根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修改旗下 4 只公募基金基金合同有关条款的公告	同上	2021 年 03 月 31 日
4	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
5	西部利得基金管理有限公司关于北京分公司地址变更的公告	同上	2021 年 12 月 27 日
6	西部利得基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关准则的公告	同上	2022 年 1 月 5 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20210104	96,170,574.51	83,709,301.10	116,992,990.99	62,886,884.62	3.89

产品特有风险

报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,可能带来流动性风险;如个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务办理;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准设立的相关文件;
- (2) 本基金《基金合同》;
- (3) 本基金更新的《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。

13.2 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

13.3 查阅方式

(1) 书面查询: 查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:00。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

2022 年 3 月 30 日